Controle de Posição

Relatório de Definições de Mensagens

Este documento descreve o conjunto de mensagens e arquivos do sistema de Controle de Posição, que permitem aos participantes efetuar a consulta de posições em aberto, a consulta de quebra de estratégias e a realização de transferência de posição de derivativos.

A implantação da integração das clearings da BM&FBOVESPA e do novo sistema de risco CORE (Closeout Risk Evaluation) depende de prévia autorização dos órgãos reguladores.

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
17/10/2014	1.16	Versão em produção na Clearing BM&FBOVESPA	

Descrição detalhada no documento “Histórico de Alterações”.

Versão de Schema

A versão deste catálogo contempla as versões abaixo dos schemas XSDs.

Nome Mensagem	Versão Schema XSD
bvmf.025.01	1.9
bvmf.026.01	1.9
SUPL.026.01	1.8
bvmf.027.01	1.11
bvmf.028.01	1.8
bvmf.030.01	1.8
bvmf.031.01	1.8
bvmf.032.01	1.8
bvmf.033.01	1.8
bvmf.076.01	1.8
bvmf.077.01	1.10
bvmf.094.01	1.10
bvmf.095.01	1.9
bvmf.096.01	1.10
bvmf.097.01	1.11
bvmf.098.01	1.9
bvmf.099.01	1.9

bvmf.082.01	1.4
bvmf.083.01	1.4
bvmf.084.01	1.4

Descrição detalhada no documento “Manual Técnico”.

Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN

Mensagem somente atendem a Clearing de Derivativos (V1 IPN)	Mensagem pode sofrer ajuste para atender Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada (V2 do IPN)	Mensagem revisada para atender V2 do IPN	Novas Mensagens para Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada
BVBG.016.01 DerivativesPositionMovement	bvmf.026.01 SecuritiesStatementQueryV02		
bvmf.076.01 StrategyBreakdownRequest	BVBG.017.01 PositionReportAccountLevel		
BVBG.027.01 StrategyBreakdownResponse	bvmf.028.01 PositionTransferInstruction		
	bvmf.030.01 PositionTransferCancellation		
	bvmf.031.01 PositionTransferStatusAdvice		
	bvmf.032.01 RequestPositionTransferStatus		
	bvmf.033.01 InformationPositionTransferReceiverLeg		
	bvmf.082.01 AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice		
	bvmf.083.01 AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse		
	bvmf.084.01 AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest		

Conteúdo

Histórico de Revisão 2
Versão de Schema 3
Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN 5
Visão geral 14
Escopo 14
Lista de Mensagens e Arquivos 14
Conteúdo do Arquivo 17
Como Ler 18
Fluxo de Mensagens: 19
Informa Posição em aberto 19
Cenário 1- Participante requisita arquivo de posição em aberto 19
Cenário 2- BVMF informa arquivo de posição em aberto ao final do dia 20
Cenário 3- Participante requisita arquivo de posição em aberto 21
Informa detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos 22
Cenário 1:BVMF informa ao PNP e PL detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos 22
Informa Quebra de Estratégia 23
Cenário 1: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia 23
Cenário 2: BM&F Informa resultado de quebra de estratégia 24
Cenário 3: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia 25

Fluxos de Transferência de Posição 26
Os fluxos de transferência de posição estão contemplados no Anexo I. 26
bvmf.026.01 - Mensagem de Solicitação do Arquivo de Posição em Aberto (SecuritiesStatementQueryV02) 26
Funcionalidade da Mensagem 26
Escopo 26
Uso 27
Diagrama da Mensagem 27
Diagrama do Supplementary Data 28
Regras 30
Estrutura 30
bvmf.026.01 - SecuritiesStatementQueryV02 30
Structure Supplementary Data - SUPL.026.01 - SecuritiesStatementQuerySD 33
BVBG.017.01 – Arquivo de posição em aberto nível de conta (PositionReportAccountLevel) 37
bvmf.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport 37
Funcionalidade da Mensagem 37
Escopo 37
Uso 38
Diagrama da Mensagem 38
Regras 40
Estrutura da Mensagem bvmf.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport 40

bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport 55
Funcionalidade da Mensagem 55
Escopo 55
Uso 55
Diagrama da Mensagem 55
Regras 56
Estrutura da Mensagem bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport 57
bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport 63
Funcionalidade da Mensagem 63
Escopo 63
Uso 63
Diagrama da Mensagem 64
Regras 65
Estrutura da Mensagem bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport 65
bvmf.096.01 – BuyInPositionReport 71
Funcionalidade da Mensagem 71
Escopo 71
Uso 71
Diagrama da Mensagem 71
Regras 72

Estrutura da Mnesagem bvmf.096.01 – BuyInPositionReport 73
bvmf.097.01 – CashMarketPositionReport 79
Funcionalidade da Mensagem 79
Escopo 79
Uso 79
Diagrama da Mensagem 79
Regras 80
Estrutura da Mensagem bvmf.097.01 – CashMarketPositionReport 81
bvmf.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport 88
Funcionalidade da Mensagem 88
Escopo 88
Uso 88
Diagrama da Mensagem 89
Regras 90
Estrutura da Mensagem bvmf.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport 90
bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport 96
Funcionalidade da Mensagem 96
Escopo 96
Uso 97
Diagrama da Mensagem 98

Regras 99
Estrutura da Mensagem bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport 99
BVBG.016.01 – Arquivo de Movimentação de Posição de Derivativos (“DerivativesPositionMovement”) 103
Funcionalidade do Arquivo 103
Escopo 103
Uso 104
Diagrama da Mensagem bvmf.025.01 104
Regras 106
Estrutura da Mensagem bvmf.025.01 – DerivativesPositionMovement 106
bvmf.076.01 - StrategyBreakdownRequest 118
Funcionalidade da Mensagem 118
Escopo 118
Uso 118
Diagrama da Mensagem 119
Regras 120
Estrutura da Mensagem bvmf.076.01 – StrategyBreakdownRequest 120
BVBG.027.01 – StrategyBreakdownResponse 123
Funcionalidade da Mensagem 123
Escopo 123
Uso 123

Diagrama da Mensagem 124
Regras 125
Estrutura da Mensagem bvmf.077.01 – StrategyBreakdownResponse 125
bvmf.028.01 – PositionTransferInstruction 135
Funcionalidade da Mensagem 135
Escopo 135
Uso 135
Diagrama da Mensagem 136
Regras 137
Estrutura da Mensagem 137
bvmf.030.01 – PositionTransferCancellation 143
Funcionalidade da Mensagem 143
Escopo 143
Uso 143
Diagrama da Mensagem 144
Regras 144
Estrutura da Mensagem 144
bvmf.031.01 – PositionTransferStatusAdvice 146
Funcionalidade da Mensagem 146
Escopo 146

Uso 146
Diagrama da Mensagem 148
Regras 149
Estrutura da Mensagem 149
bvmf.032.01 – RequestPositionTransferStatus 157
Funcionalidade da Mensagem 157
Escopo 157
Uso 157
Diagrama da Mensagem 158
Regras 158
Estrutura da Mensagem 158
bvmf.033.01 – InformationPositionTransferReceiverLeg 160
Funcionalidade da Mensagem 160
Escopo 160
Uso 160
Diagrama da Mensagem 161
Regras 161
Estrutura da Mensagem 162
bvmf.082.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice 165
Funcionalidade da Mensagem 165

Escopo....165
Uso....165
Diagrama da Mensagem....166
Regras....168
Estrutura da mensagem....168
bvmf.083.01– AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse....172
Funcionalidade da Mensagem....172
Escopo....173
Uso....173
Diagrama da Mensagem....173
Estrutura da mensagem....173
bvmf.084.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest....176
Funcionalidade da Mensagem....176
Escopo....176
Diagrama da Mensagem....176
Estrutura da mensagem....177

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de mensagens e arquivos do sistema de Controle de Posição, que permitem aos participantes efetuar a consulta de posições em aberto, a consulta de quebra de estratégias e a realização de transferência de posição de derivativos.

Cenários de negócios foram modelados e uma série de mensagens XML foram concebidas. No devido tempo, essas mensagens serão submetidos à ISO20022, órgão de registro, para aprovação. Cada cenário de negócios é representado por um fluxo de trabalho padronizado e um número fixo de mensagens normatizadas.

Lista de Mensagens e Arquivos

bvmf.026.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Posição em Aberto (“SecuritiesStatementQueryV02”)

Mensagem onde MCs, PNPs, PLs e Custodiantes podem solicitar de forma intradiária as informações momentâneas de posições em aberto nos mercados da BM&FBOVESPA atendidos pelo sistema de Controle de Posição. Os custodiantes somente podem solicitar informações referente a posições no mercado à vista, de falha de entrega e recompra.

BVBG.017.01– Arquivo de posição em aberto no nível de conta (“PositionReportAccountLevel”)

O arquivo de posição em aberto no nível de conta é gerado sob demanda como resposta da mensagem de solicitação BVMF.026.01, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver posição em aberto para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

BVBG.016.01 – Arquivo de Movimentação de Posição de Derivativos (“DerivativesPositionMovement”)

Arquivo gerado para PNPs e PLs, no final de cada data de movimento, com detalhes dos negócios efetuados nos mercados de derivativos fungíveis da BM&FBOVESPA.

bvmf 076.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownRequest”)

O sistema de controle de posições é responsável por efetuar a quebra dos negócios de estratégia realizados no mercado de derivativos financeiros e de commodities. Através desta mensagem os PNPs e PLs podem solicitar de forma intradiária o arquivo com o resultado momentâneo do processo de quebra de estratégias.

BVBG.027.01 – Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownResponse”)

O arquivo de quebra de estratégia é gerado sob demanda como resposta da mensagem de solicitação BVMF.076.01, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

bvmf.028.01 – Solicitação de transferência de posição (“PositionTransferInstruction”)

Mensagem onde os PNPs ou PLs podem solicitar a transferência de posição de derivativos fungíveis e não fungíveis.

bvmf.030.01 – Solicitação de cancelamento de transferência (“PositionTransferCancellation”)

Mensagem onde os PNPs ou PLs, origem ou destino de transferência, podem solicitar o cancelamento da transferência de posição.

bvmf.031.01 – Status da transferência (“PositionTransferStatusAdvice”)

Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência são informados do status da mesma.

bvmf.032.01 – Solicitação de status da transferência (“RequestPositionTransferStatus”)

Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência podem solicitar a mensagem de status da transferência.

bvmf.033.01 – Recebimento de transferência (“InformationPositionTransferReceiverLeg”)

Mensagem onde o PNP ou PL destino recebe a transferência no sistema.

bvmf.082.01- AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice

A mensagem IntradayRiskLimitRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação informando a avaliação de risco de transferência de posição.

bvmf.083.01 - AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse

A mensagem AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse é enviada pelo Membro de Compensação à BM&FBOVESPA para informar a aceitação ou rejeição da avaliação de risco de transferência de posição.

bvmf.084.01-AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest

A mensagem AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação à BM&FBOVESPA como requisição das informações atualizada da avaliação do risco de transferência de posição.

Conteúdo do Arquivo

Sigla do Arquivo	Nome do Arquivo	Conteúdo do Arquivo
BVBG.016.01	DerivativesPositionMovement	bvmf.025.01- DerivativesPositionMovement
BVBG.017.01	PositionReportAccountLevel	bvmf.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport bvmf.096.01 – BuyInPositionReport bvmf.097.01 – CashMarketPositionReport bvmf.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport
BVBG.027.01	StrategyBreakdownResponse	bvmf.077.01- StrategyBreakdownResponse

Como Ler

UML (Unified Modeling Language) tem sido usada para descrever modelos de negócio e lógica. Como o conhecimento de UML não é um requisito para discutir os negócios padrões, o formato de dados para as mensagens é apresentado de uma forma mais amigável. Esta forma de representação é gerada automaticamente a partir dos modelos, garantindo assim, a coerência absoluta entre as informações do modelo com a norma publicada.

Fluxo de Mensagens:

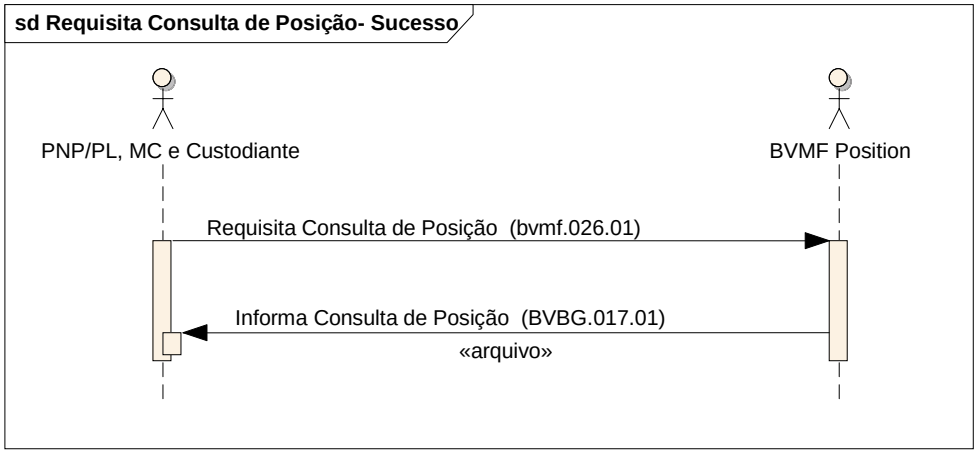
Informa Posição em aberto

Cenário 1- Participante requisita arquivo de posição em aberto

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de posição em aberto oriunda de um PNP, PL, MC ou Custodiante.

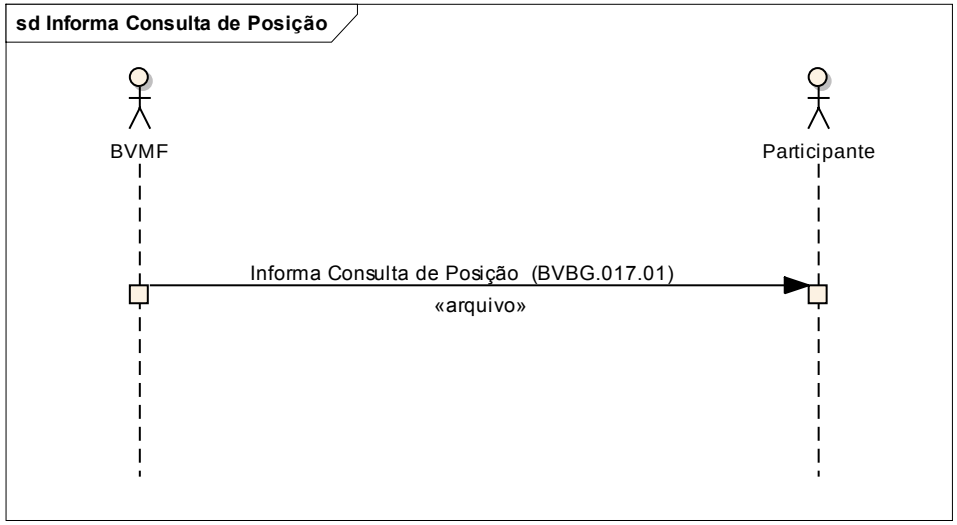
-O Participante envia a mensagem de solicitação do arquivo de posição em aberto "SecuritiesStatementQueryV02"(bvmf.026.01). Os custodiantes somente podem solicitar informações referentes a posições no mercado à vista, de falha de entrega e recompra.

- Quando o arquivo é totalmente processado, a BM&FBOVESPA envia o arquivo de posição no nível de conta BVBG017.01-PositionReportAccountLevel. Se não houver posição em aberto para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.



Cenário 2- BVMF informa arquivo de posição em aberto ao final do dia

O fluxo abaixo ilustra o envio, ao final do dia, aos PNPs, PLs, MCs e Custodiantes, do arquivo de posição em aberto BVBG017.01-PositionReportAccountLevel no encerramento da data de movimento. ..



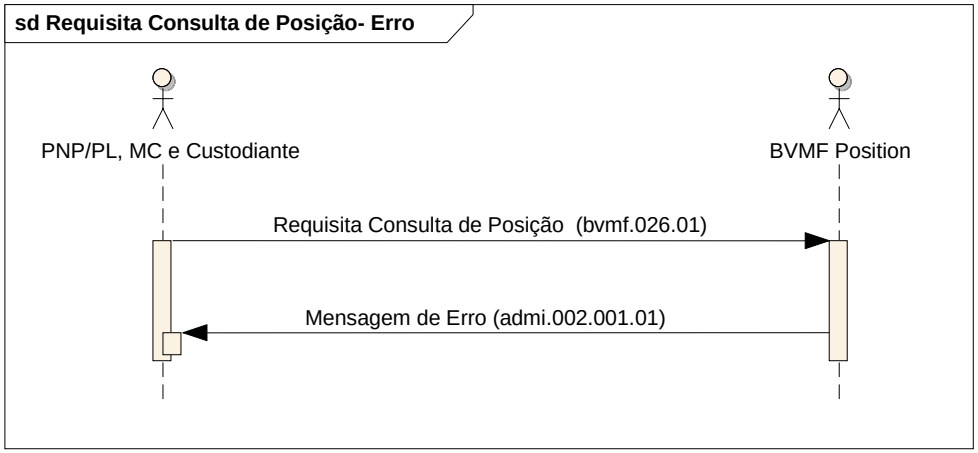
Cenário 3- Participante requisita arquivo de posição em aberto

Cenário de Erro

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de posição em aberto oriunda de um PNP, PL, MC ou Custodiante.

-O Participante envia a mensagem de solicitação do arquivo de posição em aberto "SecuritiesStatementQueryV02"(bvmf.026.01), com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

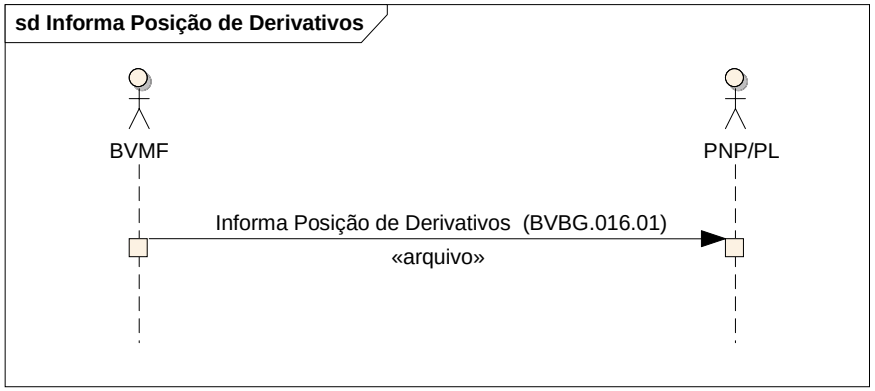
- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Requisita Consulta de Posição- Erro
PNP/PL, MC e Custodiante
BVMF Position
Requisita Consulta de Posição (bvmf.026.01)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01)

Informa detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos

Cenário 1:BVMF informa ao PNP e PL detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos

A BVMF informa ao PNP ou PL, ao final do dia, os detalhes de negócios realizados no dia no mercado de derivativos fungíveis através do arquivo de movimentação de posição de derivativos BVBG.016.01-DerivativesPositionMovement.



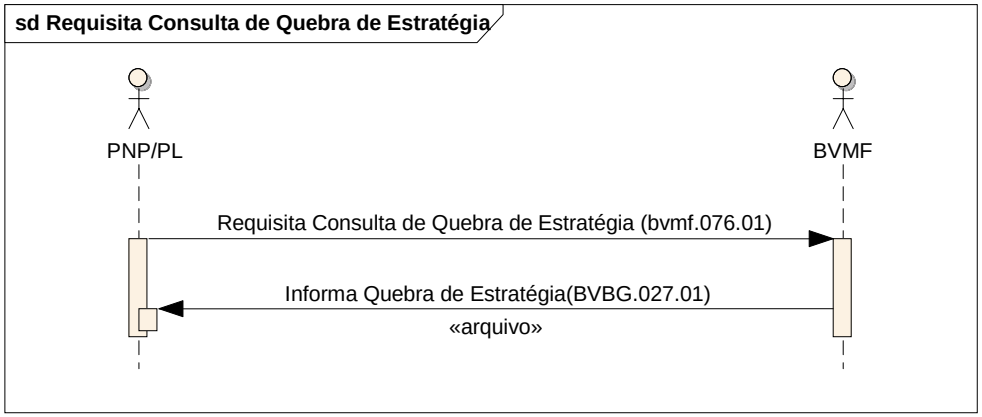
Informa Quebra de Estratégia

Cenário 1: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de quebra de estratégias oriunda de um PNP ou PL.

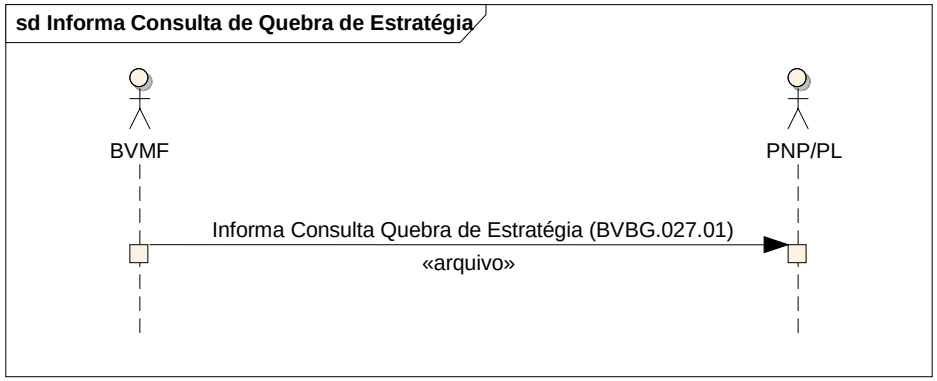
-O Participante envia a mensagem BVMF076.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownRequest”)

- Quando o arquivo é totalmente processado, a BM&FBOVESPA envia o arquivo BVBG.027.01 – Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownResponse”). Se não houver informação para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.



Cenário 2: BM&F Informa resultado de quebra de estratégia

A BVMF informa ao PNP ou PL, ao final do dia, o resultado do processo de quebra dos negócios de estratégia realizado no dia através do arquivo BVBG.027.01 – Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownResponse”).



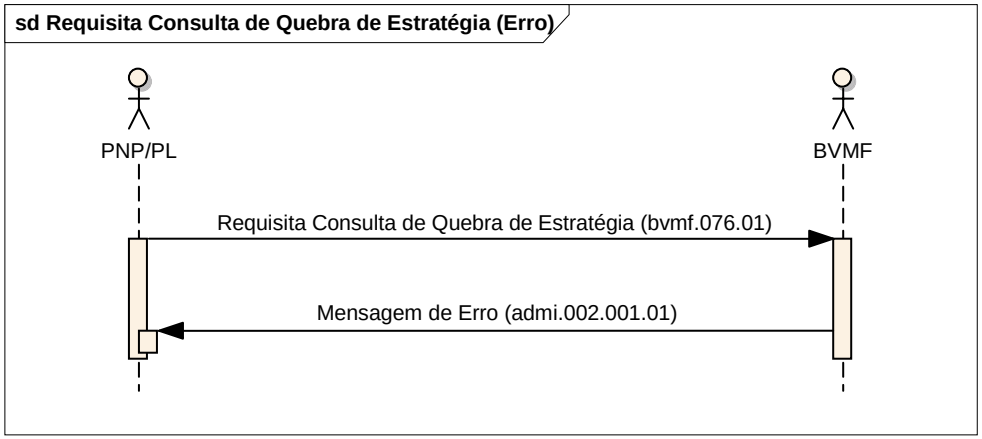
Cenário 3: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia

Cenário de Erro

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de quebra de estratégias oriunda de um PNP ou PL.

-O Participante envia a mensagem bvmf.076.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownRequest”) à BM&FBOVESPA, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Requisita Consulta de Quebra de Estratégia (Erro)
PNP/PL
BVMF
Requisita Consulta de Quebra de Estratégia (bvmf.076.01)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01)

Fluxos de Transferência de Posição

Os fluxos de transferência de posição estão contemplados no Anexo I.

bvmf.026.01 - Mensagem de Solicitação do Arquivo de Posição em Aberto (SecuritiesStatementQueryV02)

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde MCs, PNPs, PLs e Custodiantes podem solicitar de forma intradiária as informações momentâneas de posições em aberto nos mercados da BM&FBOVESPA atendidos pelo sistema de Controle de Posição. Os custodiantes somente podem solicitar informações referente a posições no mercado à vista, de falha de entrega e recompra.

Uso

Esta mensagem permite uma série de filtros para atender as necessidades específicas do participante. Pode-se filtrar o instrumento, datas, carteira e tipo de posição.

Custodiantes somente podem consultar posições de mercado à vista, falha de entrega e recompra.

Diagrama da Mensagem

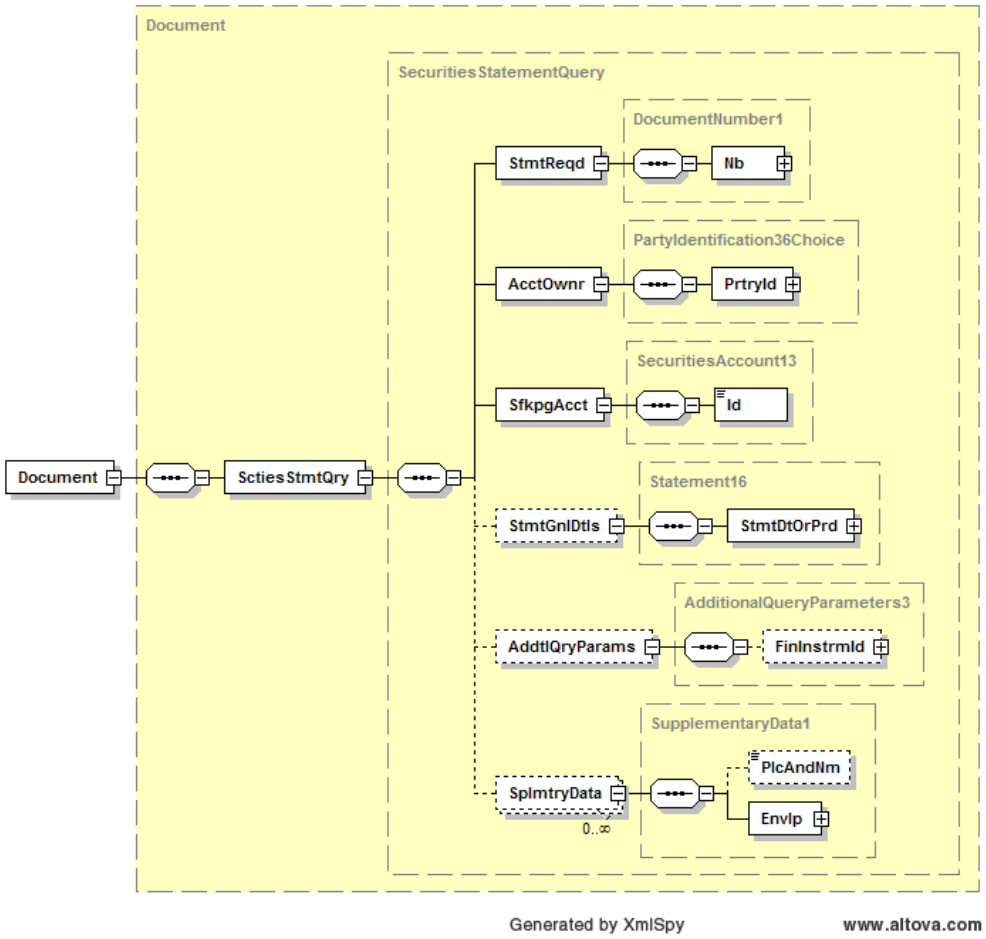
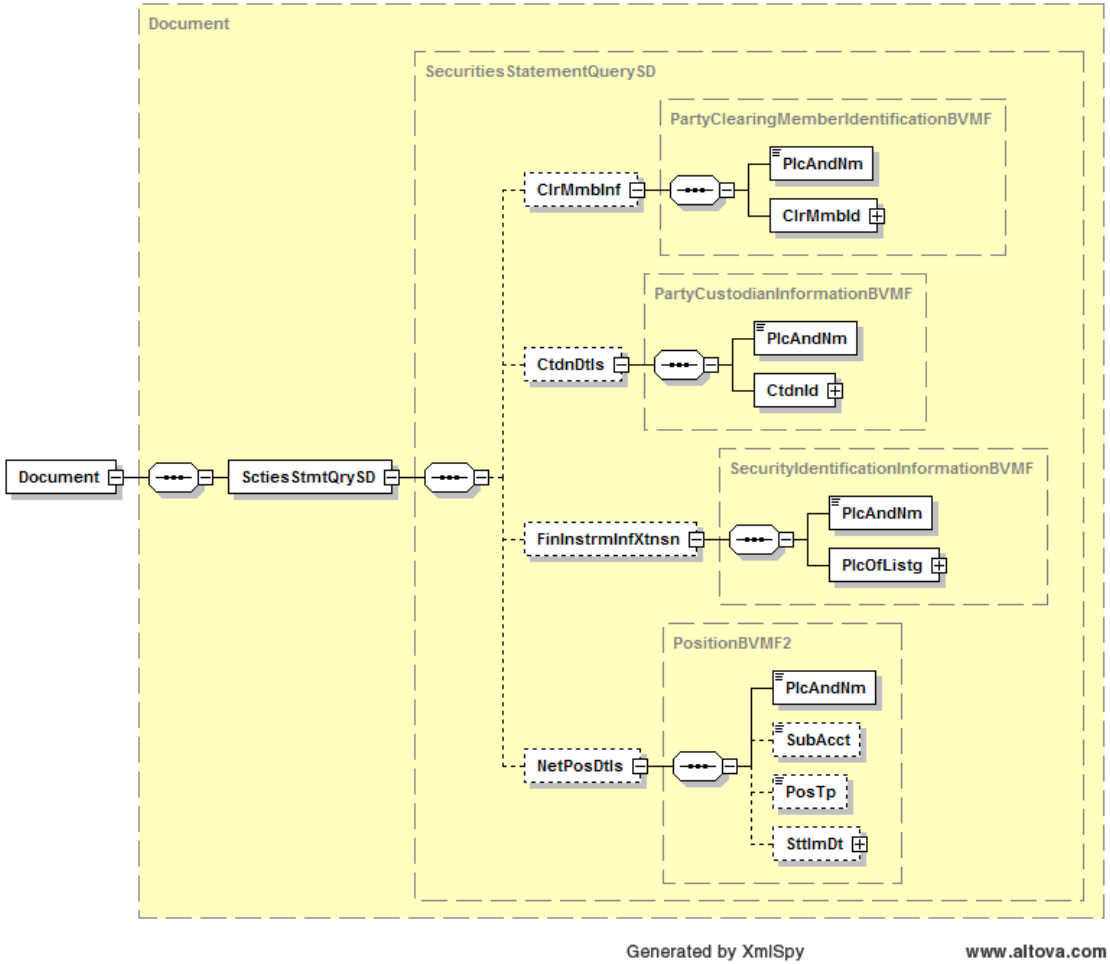


Diagrama do Supplementary Data


Document
SecuritiesStatementQuerySD
PartyClearingMemberIdentificationBVMF
ClrMmbInf
PlcAndNm
ClrMmbId
PartyCustodianInformationBVMF
CtdnDtls
PlcAndNm
CtdnId
SecurityIdentificationInformationBVMF
FinInstrmInfXtnsn
PlcAndNm
PlcOfListg
PositionBVMF2
NetPosDtls
PlcAndNm
SubAcct
PosTp
SttlmDt
Document
SctiesStmtQrySD
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

Regra 1 – Somente pode ser consultada a posição do dia ou dia seguinte, em caso de posição gerada por negócios de after-hours.

Regra 2 – O campo MC é obrigatório no caso de solicitação oriunda deste participante.

Regra 3 – Se a consulta é originada de custodiante, os campos de código de custodiante e conta de custódia devem ser preenchidos.

Regra 4 – Para a consulta utilizando o filtro de instrumento, se faz necessário informar os três atributos que identificam o instrumento dentro da Câmara, ou seja, *Exchange ID, Security Source e Security ID.*

Estrutura

bvmf.026.01 - SecuritiesStatementQueryV02

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		StatementRequested	StmtReqd	[1..1]	+	Description of the statement requested.	Este bloco identifica o “arquivo” solicitado.	
1.1		Number	Nb	[1..1]	+	Number used to identify a file.	Número utilizado para identificar o arquivo.	
1.1.1		ProprietaryNumber	PrtryNb	[1..1]	+	Proprietary number used to identify a file.	Número proprietário utilizado para identificar o arquivo.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	RestrictedFINXMax30Text	Identification used to file. E.g: BVBG.017.01.	Identificação utilizada para o arquivo. Ex: BVBG..017.01.	
2.0		AccountOwner	AcctOwnr	[1..1]	+	This block identifies the participant (TP, PL).	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL)	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SafekeepingAccount	SfkpgAcct	[1..1]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta	
3.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.0		StatementGeneralDetails	StmtGnlDtls	[0..1]	+	General information related to report.	Informações gerais relacionadas a solicitação de posição.	R1
4.1		StatementDateOrPeriod	StmtDtOrPrd	[1..1]	+	Date or period of the statement.	Data da posição.	
4.1.1		StatementDate	StmtDt	[1..1]	+	Date of the statement.	Data da posição.	
4.1.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica a data da posição.	

5.0		AdditionalQueryParameters	AddtlQryParams	[0..1]	+	Additional specific query criteria.	Este bloco contém os critérios de consulta para posição.	
5.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
5.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	
5.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	R4
5.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
5.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	R4
6.0		SupplementaryData	SplmtryData	[0..*]	+	Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro	
6.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. In the case of XML, this is expressed by a valid XPath.	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem.	
6.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+	Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	
6.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+	Technical element that specifies the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	

Structure Supplementary Data - SUPL.026.01 - SecuritiesStatementQuerySD

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ClearingMemberInformation	ClrMmbInf	[0..1]	+	This block identifies the clearing member.	Este bloco identifica o membro de compensação.	R2
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesStmtQry	
1.2		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informações do Membro de Compensação.	
1.2.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
1.2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante	

							ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2,0		CustodianDetails	CtdnDtls	[0..1]	+	This block identifies the custodian and safekeeping account.	Este bloco identifica o custodiante e a conta de custódia.	R3
2.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido. //Document/SctiesStmtQry	
2.2		CustodianIdentification	CtdnId	[1..1]	+	Block contains the identity of the custodian and the safekeeping account	Bloco que contém a identificação do custodiante e da conta de custódia.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Party that legally owns the account.	Este bloco identifica o custodinate	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo	

						The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP(Trading Participant).	ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.0		FinancialInstrumentInformationExtension	FinInstrmInfXtnsn	[0..1]	+	Block contains information of the instrument	Este bloco contem informações adicionais de instrumento que não foram abordadas na mensagem original.	
3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry/AddtlQryParams/FinInstrmInf	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesStmtQry/AddtlQryParams/FinInstrmInf	
3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market(s) on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	

3.2.1	{OR	MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	R4
4.0		NetPositionDetails	NetPosDtls	[0..1]	+	Provides the net positions details.	Fornece detalhes das informações de posição.	
4.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesStmtQry	
4.2		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
4.3		PositionType	PosTp	[0..1]	ExternalPositionTypeCode	Cash Market, Settlement failure, Buy in, Fungible Derivatives and Physical Delivery. The "PositionType" field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is "ExternalPositionTypeCode" in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Contém os tipos de posição disponível para ser solicitado via mensageria. Ex: Cash Market, Settlement failure, Buy in, Fungible Derivatives and Physical Delivery. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é "ExternalPositionTypeCode" no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.4		SettlementDate	SttlmDt	[0..1]	+	Settlement date of position	Este bloco contém a data de liquidação.	
4.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário.	

BVBG.017.01 – Arquivo de posição em aberto nível de conta (PositionReportAccountLevel)

O arquivo “PositionReport” (BVBG.017.01) é composto pelas seguintes mensagens:

BVMF.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport

BVMF.094.01 – SettlementFailurePositionReport

BVMF.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport

BVMF.096.01 – BuyInPositionReport

BVMF.097.01 – CashMarketPositionReport

BVMF.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport

BVMF.099.01 – OverTheCounterPositionReport

Este arquivo de posição em aberto é gerado no nível de conta, disponível para MCs, PNPs, PLs e Custodiantes. Aos MCs não é disponibilizada a informação dos dados do cliente final.

bvmf.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto nos mercados de derivativos fungíveis, basicamente posições de futuros, opções e swap cambial com ajuste periódico.

Uso

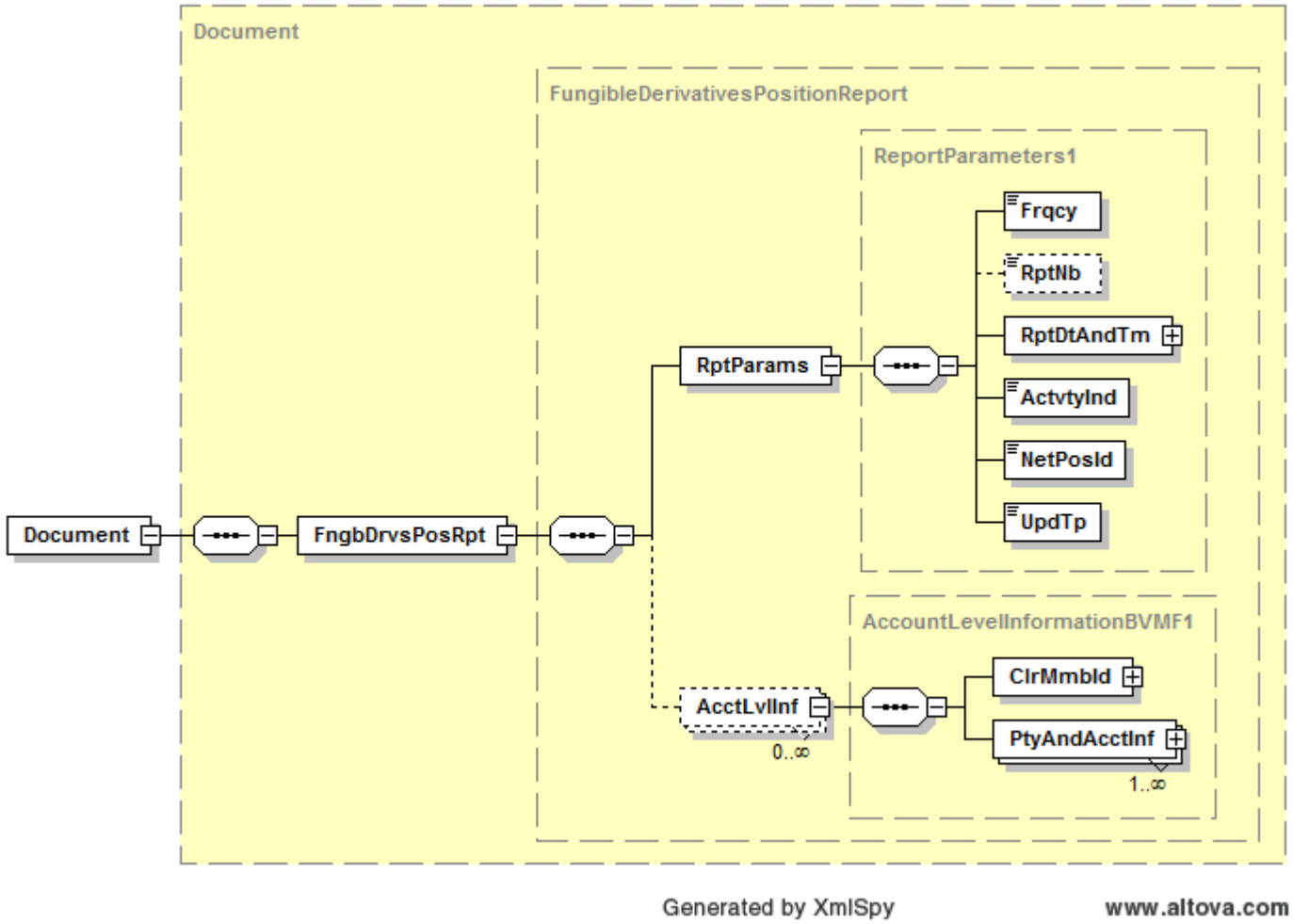
Esta mensagem traz informações de posição inicial, movimentações de posição, posição atual e cálculos financeiros. As posições são atualizadas de acordo com a chegada de eventos de movimentação, como por exemplo, novos negócios e alocações, transferências, baixas de posição, novos preços, etc.

Os cálculos financeiros são atualizados de acordo com a movimentação de posições e a chegada de novas informações de preço. Quando os preços utilizados são de caráter provisório isto é informado no arquivo.

Este arquivo traz informações específicas de contratos futuros, de opções, de opções sobre ações e swap cambial, dessa forma, alguns campos são aplicáveis somente a alguns mercados.

É importante destacar que um arquivo solicitado durante o dia pode ser alterado devido a movimentações de posições ou novas informações de preço, dessa forma, os arquivos de posição trazem indicativo se o arquivo foi gerado por solicitação ou ao final do dia no processamento final do sistema.

Diagrama da Mensagem


Document
FungibleDerivativesPositionReport
ReportParameters1
Frqcy
RptNb
RptDtAndTm
ActvtyInd
NetPosId
UpdTp
RptParams
Document
FngbDrvsPosRpt
AccountLevelInformationBVMF1
ClrMmbId
PtyAndAcctInf
1..∞
AcctLvlInf
0..∞
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Regra 2 – Não aplicável a opções sobre ações.

Regra 3 – Os campos abaixo somente terão informação quando da inclusão de opções sobre ação no Controle de Posição:

- Distribuição da opção;
- ISIN do ativo objeto;
- Distribuição do ativo objeto;
- Indicador tipo de série;
- Fator de cotação;
- Posição vendida coberta;
- Posição vendida descoberta; e
- Posição de BOX.

Regra 4 – Aplicável somente para posições de opções.

Regra 5 – Aplicável somente para posições de swap cambial.

Estrutura da Mensagem bvmf.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides Account Level Information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information	Informações do Membro de Compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account	Este bloco identifica o participante (PNP pu PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Proprietary information, often a code, issued by the data source scheme issuer. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo	

						The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456 TP (Trade Participant).	é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações sobre a conta do participante.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		FungibleDerivativesPositionInformation	FngbDrvsPosInf	[1..*]	+	This block describles the Fungible Derivatives Position.	Informações da Posição de Derivativos Fungíveis.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	

2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifier Code	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

2.2.2.3.2.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

2.2.2.3.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.3.2		RoundLotContractSize	RndLotCtrctSz	[1..1]	DecimalNumber	For options on equities= Round lot For financial and comodditties derivatives = Contract multiplier Definition Round lot: Multiple and minimum quantity of securities that can be purchased or sold. Definiiton Contract size: Ratio or multiplying factor used to convert the contract quotation to the contract size	Para opções sobre equities = Lote padrão. Para derivativos de comodditties e financeiros= Multiplicador do contrato Definição de Lote padrão: Quantidade mínima e múltiplia de papéis que pode ser adquirida ou vendida. Definição de tamanho do contrato: Relação ou fator de multiplicação utilizado para converter a cotação do contrato no tamanho do contrato.	
2.2.2.3.3.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	

2.2.2.3.3.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	R2
2.2.2.3.3.5		ExpirationCode TypeIndicator	XprtnCdTpInd	[0..1]	ExternalExpirationCodeTypeIndicatorCode	Series type indicator. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalExpirationTypeIndicatorCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Indicador do tipo da série. Este campo depende de uma lista externa de códigos. Os códigos e valores estão em uma planilha de códigos para permitir uma manutenção flexível em função das necessidades de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso, a lista é "ExternalExpirationTypeIndicatorCode" e está disponível no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R3
2.2.2.3.3.6		OptionDistributionIdentification	OptnDstrbtnId	[0..1]	int	Distribution number of the option.	Número de distribuição da opção.	R3
2.2.2.3.3.7		UnderlyingInstrument	UndrlygInstrm	[0..1]	Max12Text	Underlying Security Identifier International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	Identificador do instrumento subjacente. INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor.	R3

							c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.3.8		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Option's underlying asset distribution code.	Número da distribuição do ativo objeto da opção.	R3
2.2.2.3.3.9		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado em que o titular de um derivativo vai comprar ou vender um instrumento subjacente.	R4
2.2.2.3.3.9.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Exercise Price.	Preço de exercício.	
2.2.2.3.3.10		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente).	R4
2.2.2.3.3.10.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
2.2.2.3.3.11		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	R3

2.2.2.3.3.12		OptionStyle	OptnStyle	[0..1]	+	Specifies how an option can be exercised (American, European, Bermudan)	Informa como a opção pode ser exercida. Ex: Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento.	R4
2.2.2.3.3.12.1		Code	Cd	[1..1]	OptionStyle2Code	Option style expressed as an ISO 20022 code.	Informa como a opção pode ser exercida. Ex: Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento. Valores Válidos AMER ou EURO.	
2.2.2.3.3.13		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	ISODate	Expiration Date.	Data de Vencimento.	
2.2.2.3.4		PositionDate	PosDt	[1..1]	ISODate	Position Date.	Data da posição	
2.2.2.3.5		InitialLongQuantity	InitlLngQty	[0..1]	+	Initial long position	Posição Inicial Comprada	
2.2.2.3.5.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.6		InitialShortQuantity	InitlShrtQty	[0..1]	+	Initial Short Position	Posição Inicial Vendida.	
2.2.2.3.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.7		ExpiredLongQuantity	ExprLngQty	[0..1]	+	The quantity of long positions that has been expired.	Posição vencida comprada	
2.2.2.3.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.8		ExpiredShortQuantity	ExprShrtQty	[0..1]	+	The quantity of short positions that has been expired	Posição vencida vendida.	
2.2.2.3.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.9		ClosedDueToExerciseLongQuantity	ClsdDueToExrcLngQty	[0..1]	+	Long position closed due to exercise.	Posição comprada encerrada por exercício.	
2.2.2.3.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.10		ClosedDueToExerciseShortQu	ClsdDueToExrcShrtQty	[0..1]	+	Short position closed due to exercise.	Posição vendida encerrada por exercício	

		antity						
2.2.2.3.10.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.11		PurchaseOnDay	PurchsOnDay	[0..1]	+	Quantity purchased on the day.	Quantidade comprada no dia.	
2.2.2.3.11.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.12		SaleOnDay	SaleOnDay	[0..1]	+	Quantity sold on the day.	Quantidade vendida no dia.	
2.2.2.3.12.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.13		SentTransferLongQuantity	SntTrfLngQty	[0..1]	+	Long position sent by transfer.	Posição comprada enviada por transferência.	
2.2.2.3.13.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.14		SentTransferShortQuantity	SntTrfShrtQty	[0..1]	+	Short position sent by transfer.	Posição vendida enviada por transferência.	
2.2.2.3.14.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.15		ReceivedTransferLongQuantity	RcvdTrfLngQty	[0..1]	+	Long position received by transfer.	Posição comprada recebida por transferência.	
2.2.2.3.15.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.16		ReceivedTransferShortQuantity	RcvdTrfShrtQty	[0..1]	+	Short position received by transfer.	Posição vendida recebida por transferência.	
2.2.2.3.16.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.17		ClosedDueToPhysicalLongDelivery	ClsdDueToPhysLngDlvry	[0..1]	+	Long position closed due to physical delivery.	Posição comprada encerrada por entrega física.	
2.2.2.3.17.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.18		ClosedDueToPhysicalShortDelivery	ClsdDueToPhysShrtDlvry	[0..1]	+	Short position closed due to physical delivery.	Posição vendida encerrada por entrega física.	
2.2.2.3.18.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.19		CurrentLongQuantity	CurLngQty	[0..1]	+	Current long position.	Posição atual comprada.	
2.2.2.3.19.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.20		CurrentShortQuantity	CurShrtQty	[0..1]	+	Current short position.	Posição atual vendida.	
2.2.2.3.20.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor	

							numérico.	
2.2.2.3.21		CoveredShortQuantity	CvrdShrtQty	[0..1]	+	Covered short position,	Posição vendida coberta.	R3
2.2.2.3.21.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.22		UncoveredShortQuantity	UcvrdShrtQty	[0..1]	+	Not covered short position.	Posição vendida descoberta.	R3
2.2.2.3.22.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.23		BOXPosition	BOXPos	[0..1]	+	Position quantity part of a BOX strategy.	Quantidade da posição pertencente a uma estratégia de BOX.	R3
2.2.2.3.23.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.24		ClosedLongQuantity	ClsdLngQty	[0..1]	+	Closed long position.	Posição comprada encerrada.	
2.2.2.3.24.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.25		ClosedShortQuantity	ClsdShrtQty	[0..1]	+	Closed short position.	Posição vendida encerrada.	
2.2.2.3.25.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.26		PositionFinancialLongAmount	PosFinLngAmt	[0..1]	+	Long position value.	Valor da posição comprada.	
2.2.2.3.26.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Long position value.	Valor da posição comprada.	
2.2.2.3.27		PositionFinancialShortAmount	PosFinShrtAmt	[0..1]	+	Short position value.	Valor da posição vendida.	
2.2.2.3.27.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Short position value.	Valor da posição vendida.	
2.2.2.3.28		VariationMargin	VartnMrgn	[0..2]	+	Variation Margin.	Ajuste diário.	
2.2.2.3.28.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation Margin.	Ajuste diário.	
2.2.2.3.28.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.29		InitialPositionVariationMargin	InitlPosVartnMrgn	[0..2]	+	Variation margin related to the initial position.	Ajuste diário relacionado a posição inicial.	
2.2.2.3.29.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3Act	Variation Margin.	Ajuste diário.	

					iveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount			
2.2.2.3.29.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.30		VariationMarginTransferReceived	VartnMrgnTrfRcvd	[0..2]	+	Variation margin related to the position received by transfer.	Ajuste diário referente a posição recebida por transferência.	
2.2.2.3.30.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation Margin.	Ajuste diário.	
2.2.2.3.30.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.31		TradeOfDayVariationMargin	TradOfDayVartnMrgn	[0..2]	+	Variation margin related to the trades of the day.	Ajuste diário relacionado aos negócios do dia.	
2.2.2.3.31.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation Margin.	Ajuste diário.	
2.2.2.3.31.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.32		CumulativeVariationMargin	CmltvVartnMrgn	[0..2]	+	Cumulative variation margin.	Ajuste acumulado.	
2.2.2.3.32.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cumulative variation margin.	Ajuste acumulado.	
2.2.2.3.32.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.33		VariationMarginClosedPosition	VartnMrgnClsdPos	[0..2]	+	Cumulative variation margin applicable over the closed position.	Ajuste acumulado aplicado sobre a posição encerrada.	
2.2.2.3.33.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cumulative variation margin applicable over the closed position.	Ajuste acumulado aplicado sobre a posição encerrada.	
2.2.2.3.33.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.34		Premium	Prm	[0..2]	+	Option's premium.	Prêmio de opção.	
2.2.2.3.34.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Option's premium.	Prêmio de opção.	
2.2.2.3.34.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a	Crédito ou débito.	

						debit.		
2.2.2.3.35		FinalValueLegVariableCode	FnlValLegVarblCd	[0..1]	+	Final Value Leg Variable Code	Código Variável Valor Final	R5
2.2.2.3.35.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.36		DaysNetPositionFinal	DaysNetPosFnl	[0..2]	+	Day's Net Position - Final Value Leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Valor Final	R5
2.2.2.3.36.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Net Position - Final Value Leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Valor Final.	
2.2.2.3.36.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.37		ValueReceivedByTransferFinal	ValRcvdByTrfFnl	[0..2]	+	Value Received by Transfer - Final Value Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável Valor Final.	R5
2.2.2.3.37.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Received by Transfer - Final Value Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável Valor Final.	
2.2.2.3.37.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.38		ValueSentByTransferFinal	ValSntByTrfFnl	[0..2]	+	Value sent by transfer - Final Value Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável Valor Final.	R5
2.2.2.3.38.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Sent by Transfer - Final Value Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável Valor Final.	
2.2.2.3.38.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.39		DaysUpdatedPositionFinal	DaysUpdtdPosFnl	[0..2]	+	Day's Updated Position - Final Value Leg.	Posição atualizada do dia - Variável Valor Final.	R5
2.2.2.3.39.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Updated Position - Final Value Leg.	Posição atualizada do dia - Variável Valor Final.	
2.2.2.3.39.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.40		SpreadRateLegVariableCode	SprdRateLegVarblCd	[0..1]	+	Spread Rate Leg Variable Code	Código Variável Cupom	R5

2.2.2.3.40.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.41		DaysNetPositionSpread	DaysNetPosSprd	[0..2]	+	Day's Net Position – Spread rate leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Cupom	R5
2.2.2.3.41.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Net Position – Spread rate leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável cupom.	
2.2.2.3.41.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.42		ValueReceivedByTransferSpread	ValRcvdByTrfSprd	[0..2]	+	Value Received by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável cupom	R5
2.2.2.3.42.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Received by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável cupom.	
2.2.2.3.42.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.43		ValueSentByTransferSpread	ValSntByTrfSprd	[0..2]	+	Value Sent by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável cupom	R5
2.2.2.3.43.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Sent by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável Cupom.	
2.2.2.3.43.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.44		DaysUpdatedPositionSpread	DaysUpdtdPosSprd	[0..2]	+	Day's Updated Position - Spread Rate Leg.	Posição atualizada do dia - Variável Cupom	R5
2.2.2.3.44.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Updated Position - Spread Rate Leg	Posição atualizada do dia - Variável cupom.	
2.2.2.3.44.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
2.2.2.3.45		CashSettlement	CshSttlm	[0..2]	+	Cash settlement value.	Valor de Liquidação.	
2.2.2.3.45.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cash settlement value.	Valor de Liquidação.	
2.2.2.3.45.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	

2.2.2.3.46		PricingInformation	PricgInf	[0..1]	+	Contains information about which will be the basis of calculation used for the price adjustment.	Contem informações sobre qual será a base de calculo utilizado para o preço de ajuste.	
2.2.2.3.46.1		BaseCalculationPricing	BaseClctnPricg	[1..1]	ExternalBaseCalculationPricingCode	Indicates if calculations are based on preliminary (P) or final prices (F)	Indica se a base de cálculo será sobre o preço preliminar ou preço final.	

bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport

Funcionalidade da Mensagem

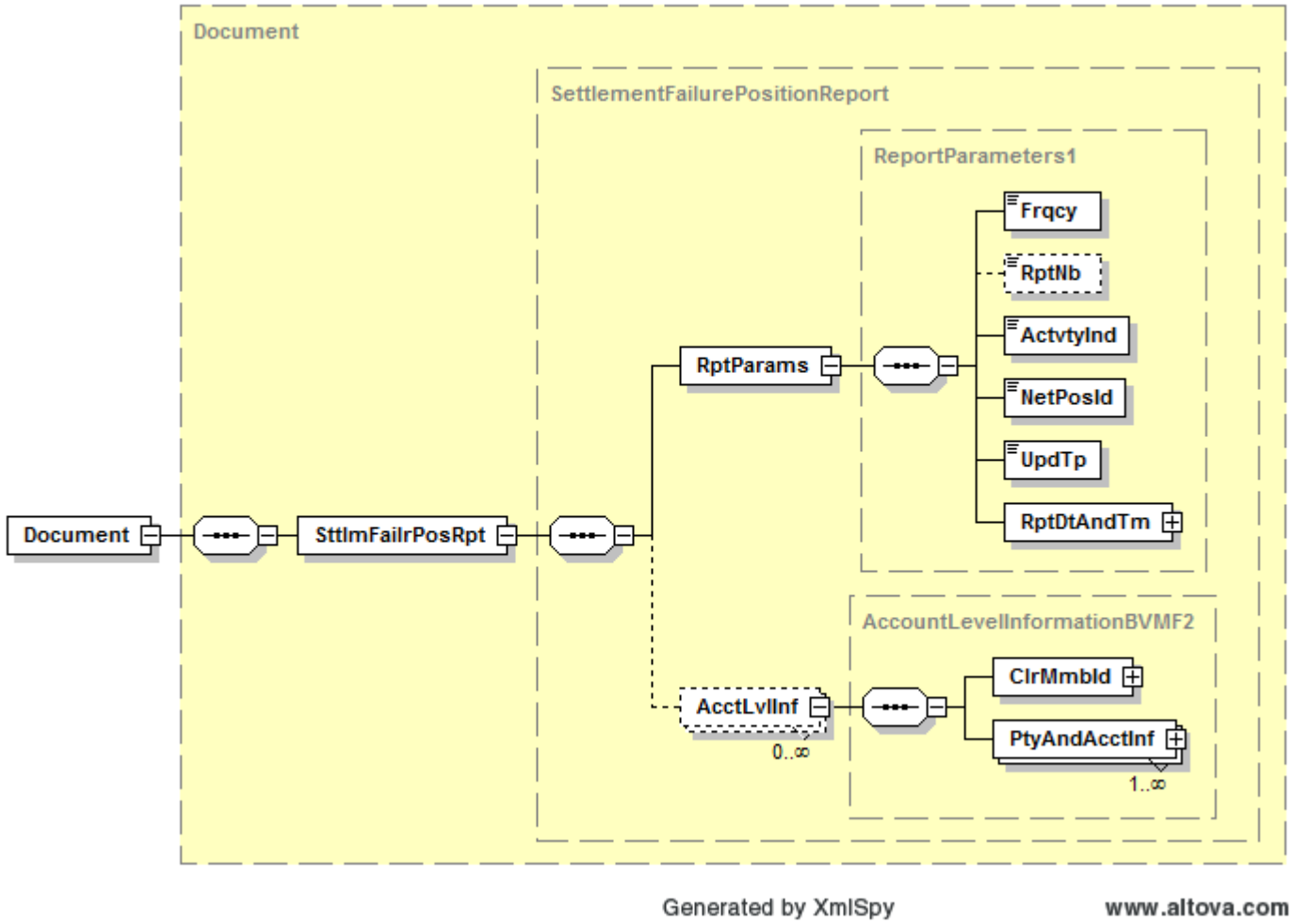
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto de falhas de entrega de ativos.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes acompanhar as posições com falha de entrega de ativos sob sua responsabilidade. Na primeira versão do sistema, estas posições não estarão disponíveis no sistema de Controle de Posições.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mensagem bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	

2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	

2.2.2.3		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.3.1		CustodianIdentification	CtdnId	[0..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.3.2		SafekeepingAccountInformation	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1		SafekeepingAccountIdentification	SfkpgAcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.3.2.2		SettlementFailureInformation	SttlmFailrInf	[1..*]	+	This block provides the Delivery Failure Position information.	Este bloco fornece informações das posições de falha de entrega.	
2.2.2.3.2.2.1		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.2.1.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	

2.2.2.3.2.2.2		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.2.2.2.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.3.2.2.3		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.3.2.2.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.4		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	Provides settlement date.	Informa a data de liquidação.	
2.2.2.3.2.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.5		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
2.2.2.3.2.2.6		LongQuantity	LngQty	[0..1]	+	Long quantity.	Quantidade comprada.	
2.2.2.3.2.2.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.7		LongAveragePrice	LngAvrgPric	[0..1]	+	Average long price.	Preço médio de compra.	
2.2.2.3.2.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average price.	Preço médio.	
2.2.2.3.2.2.8		LongGrossTradeAmount	LngGrssTradAmt	[0..1]	+	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	
2.2.2.3.2.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	
2.2.2.3.2.2.9		ShortQuantity	ShrtQty	[0..1]	+	Short quantity.	Quantidade vendida.	
2.2.2.3.2.2.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.10		ShortAveragePrice	ShrtAvrgPric	[0..1]	+	Average short price.	Preço médio de venda.	
2.2.2.3.2.2.10.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average price.	Preço médio.	
2.2.2.3.2.2.11		ShortGrossTradeAmount	ShrtGrssTradAmt	[0..1]	+	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	
2.2.2.3.2.2.11.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	

bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

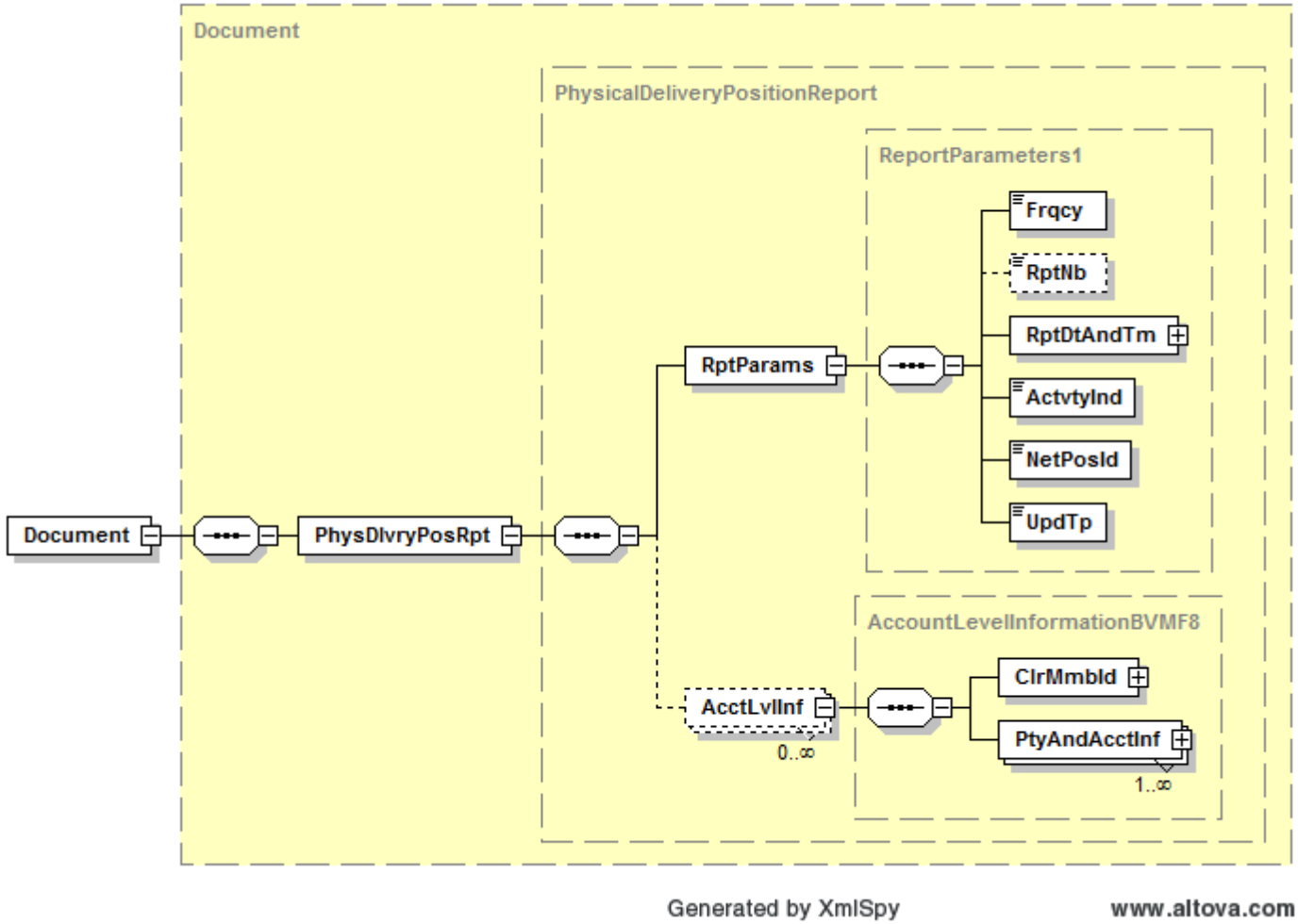
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto de commodities agrícolas em procedimento de entrega física.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs e MCs acompanhar as posições de commodities agrícolas em procedimento de entrega física sob sua responsabilidade. Após a posição de futuro ser baixada por entrega física, o sistema de Controle de Posições mantém a posição de entrega física até a sua efetiva liquidação.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mensagem bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	

2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única, como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista externa de códigos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso a identificação externa é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	

						115 = Account Number	115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		PhysicalDeliveryPositionInformation	PhysDlvryPosInf	[1..*]	+	This block describle the Physical Delivery Position.	Este bloco contém informações da posição de entrega física.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN	

2.2.2.3.2.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.3.3		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttr bts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

2.2.2.3.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarket Code	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[1..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4		DeliveryNoticeDate	DlvryNtceDt	[1..1]	+	Delivery Notice Allocation Date	Data de alocação do aviso de entrega.	

2.2.2.3.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.5		DeliveryPrice	DlvryPric	[1..1]	+	Delivery Price	Preço de Entrega.	
2.2.2.3.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Delivery price	Preço de Entrega.	
2.2.2.3.6		LongQuantityPosition	LngQtyPos	[0..1]	+	Describes the quantity purchased in Physical Delivery Process.	Posição comprada em procedimento de entrega física.	
2.2.2.3.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.7		ShortQuantityPosition	ShrtQtyPos	[0..1]	+	Describes the quantity sold in Physical Delivery Process.	Posição vendida em procedimento de entrega física.	
2.2.2.3.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

bvmf.096.01 – BuyInPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

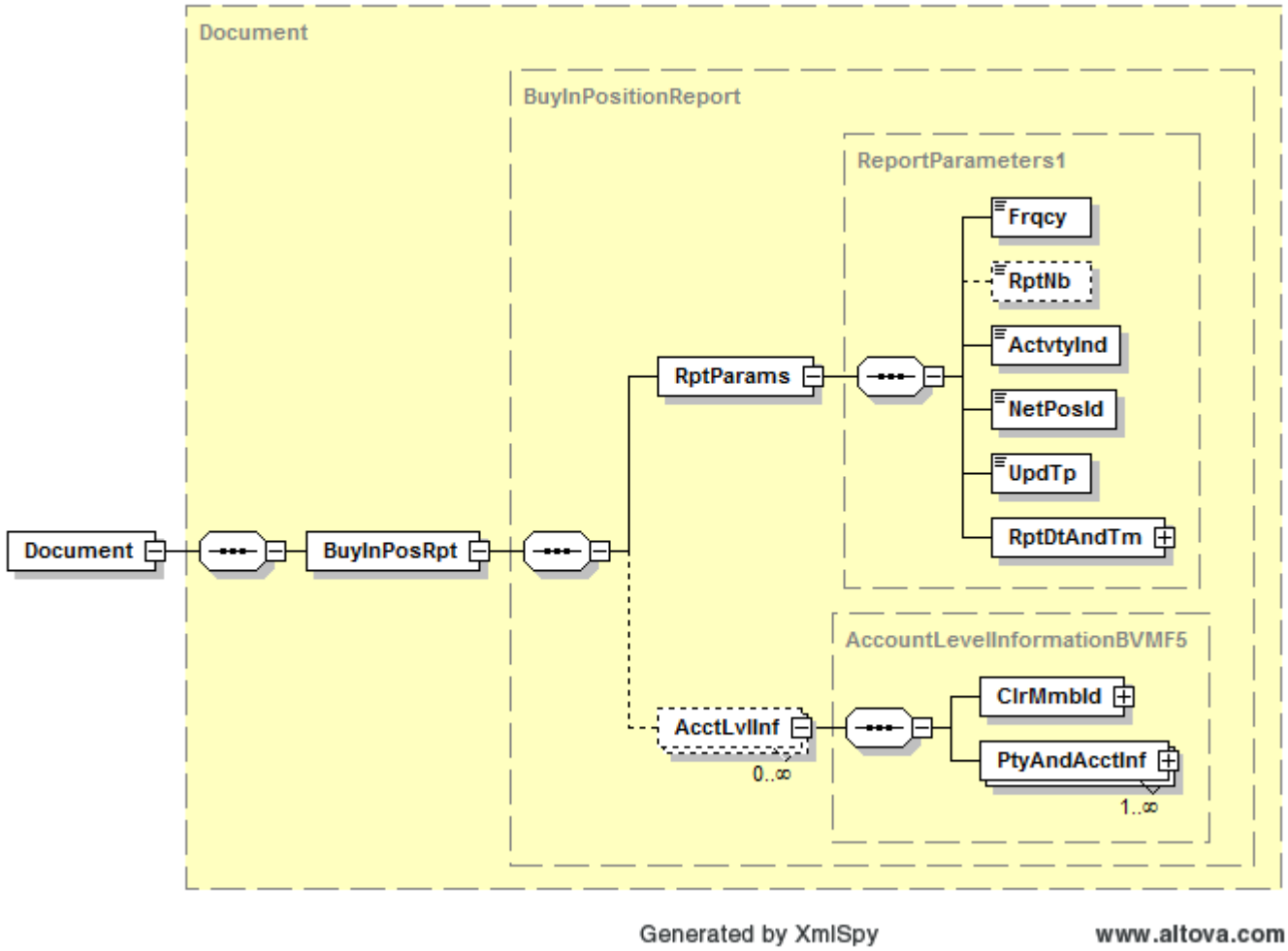
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto de recompra de ativos.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes acompanhar as posições de recompra de ativos sob sua responsabilidade. Na primeira versão do sistema, estas posições serão abertas somente em caso de falha de entrega de ouro a vista.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mnesagem bvmf.096.01 – BuyInPositionReport

Index	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericT ext	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default “true”.	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão “true”.	
1.4		NetPositionIdentifica tion	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdat eType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndT m	[1..1]	+	Date and time of the report.	Data e hora do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInform ation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIde ntification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution..	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentificat ion	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.3.1		CustodianIdentification	CtdnId	[0..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de	

						proprietary identification scheme.	identificação proprietária.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.3.2		SafekeepingAccount Information	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1		SafekeepingAccount Identification	SfkpgAcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.3.2.2		BuyInPositionInform ation	BuyInPosInf	[1..*]	+	This block provides buy In position information.	Este bloco fornece informações da posição de Recompra.	
2.2.2.3.2.2.1		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	

2.2.2.3.2.2.1.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.2.2.2		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.2.2.2.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.3.2.2.3		BuyInIdentification	BuyInId	[1..1]	Max35Text	Indicates the reference id of the buy in.	Número da recompra.	
2.2.2.3.2.2.4		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.3.2.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.5		SettlementDate	SttlmDt	[0..1]	+	Provides the close out date of the buy in position.	Fornece a data de encerramento da posição de recompra.	
2.2.2.3.2.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.6		Side	Sd	[1..1]	Side1Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	

2.2.2.3.2.2.7		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
2.2.2.3.2.2.8		OriginalQuantity	OrgnlQty	[1..1]	+	Provides original quantity information.	Quantidade original.	
2.2.2.3.2.2.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.9		CancelledQuantity	CancQty	[0..1]	+	Provides cancelled quantity information.	Quantidade cancelada.	
2.2.2.3.2.2.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.10		ExecutedQuantity	ExctdQty	[0..1]	+	Provides executed quantity information.	Quantidade executada.	
2.2.2.3.2.2.10.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.11		RevertedQuantity	RvrdQty	[0..1]	+	Provides reverted quantity information.	Quantidade revertida.	
2.2.2.3.2.2.11.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.12		OriginalValue	OrgnlVal	[1..1]	+	Provides original value information.	Valor original.	
2.2.2.3.2.2.12.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
2.2.2.3.2.2.13		CancelledValue	CancVal	[0..1]	+	Provides cancelled value information.	Valor cancelado.	
2.2.2.3.2.2.13.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
2.2.2.3.2.2.14		ExecutedValue	ExctdVal	[0..1]	+	Provides executed value.	Valor executado.	
2.2.2.3.2.2.14.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
2.2.2.3.2.2.15		RevertedValue	RvrdVal	[0..1]	+	Provides reverted value information.	Valor revertido.	
2.2.2.3.2.2.15.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	

2.2.2.3.2.2.16		AveragePriceOriginalDelivery	AvrgPricOrgnlDlvry	[0..1]	+	Provides average price of the original delivery information.	Preço médio entrega original.	
2.2.2.3.2.2.16.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
2.2.2.3.2.2.17		ReversionPrice	RvsrnPric	[0..1]	+	Provides reversion price.	Preço da reversão.	
2.2.2.3.2.2.17.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	

bvmf.097.01 – CashMarketPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

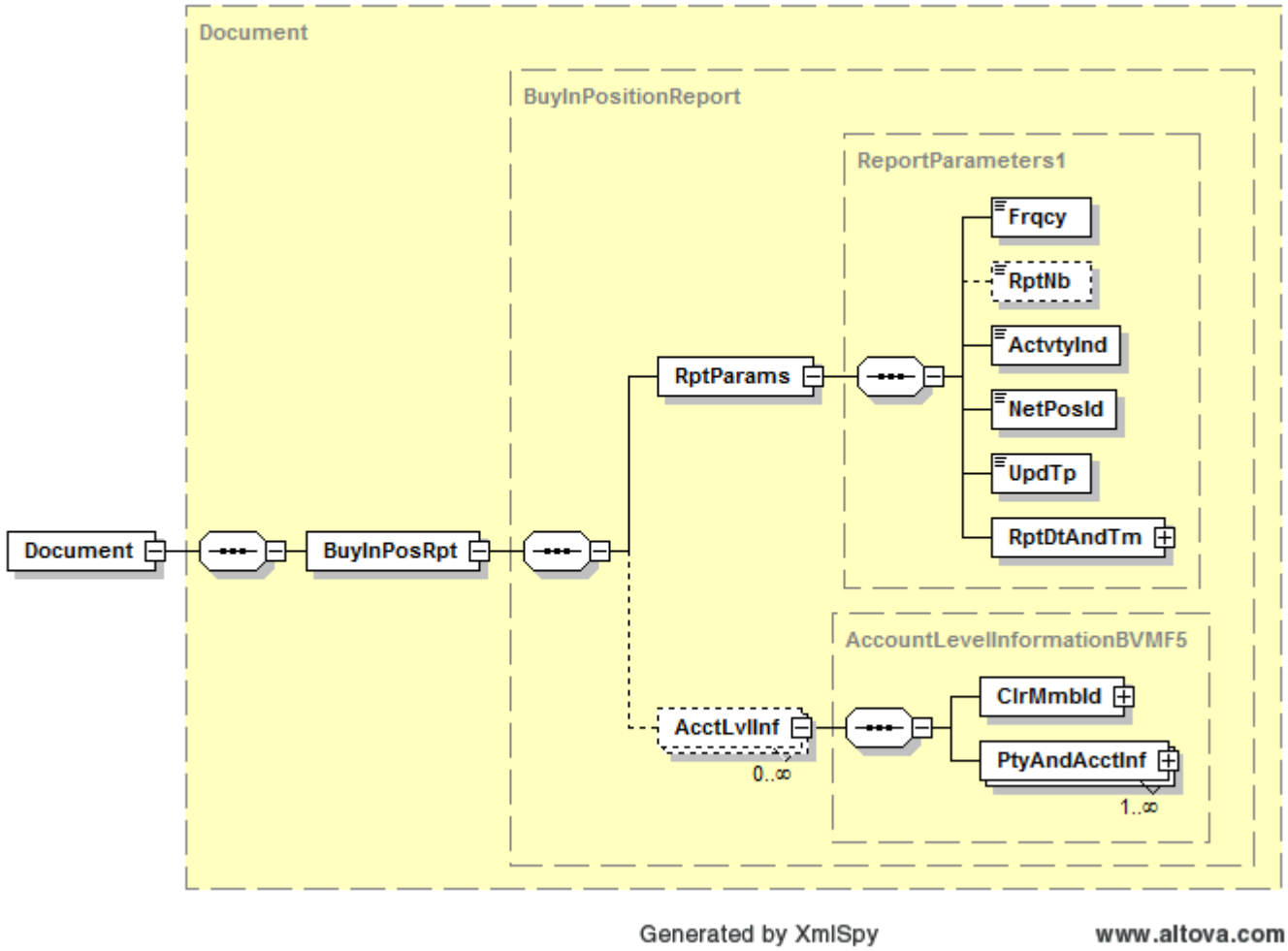
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto no mercado à vista ainda não liquidadas.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes acompanhar as posições em aberto não liquidadas no mercado à vista sob sua responsabilidade. Na primeira versão do sistema, estas posições serão somente de ouro à vista.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Regra 2 – A informação de fator de cotação não é disponibilizada para o mercado de ouro.

Estrutura da Mensagem bvmf.097.01 – CashMarketPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default “true”.	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão “true”.	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date and time of the report.	Data e hora do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information	Informações do Membro de Compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution..	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de	

						proprietary identification scheme.	identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndActInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.3.1		CustodianIdentification	CtdnId	[0..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	

2.2.2.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40	
2.2.2.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.3.2		SafekeepingAccountInformation	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1		SafekeepingAccountIdentification	SfkpgAcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.3.2.2		CashMarketPositionInformation	CshMktPosInf	[1..*]	+	This block provides Cash Market position information.	Este bloco fornece informações da posição do mercado a vista.	

2.2.2.3.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.3.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	
2.2.2.3.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2.2.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.2.2.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie,	

							quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.2.2.2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.3.2.2.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.2.2.3.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.3.2.2.3.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.2.2.3.3		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	R2

2.2.2.3.2.2.4		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.3.2.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.5		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	Provides settlement date	Informa a data de liquidação.	
2.2.2.3.2.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.6		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
2.2.2.3.2.2.7		LongQuantity	LngQty	[0..1]	+	Long quantity.	Quantidade comprada.	
2.2.2.3.2.2.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.8		LongAveragePrice	LngAvrgPric	[0..1]	+	Average long price	Preço médio de compra.	
2.2.2.3.2.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average price	Preço Médio	
2.2.2.3.2.2.9		LongGrossTradeAmount	LngGrssTradAmt	[0..1]	+	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	
2.2.2.3.2.2.9.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	
2.2.2.3.2.2.10		ShortQuantity	ShrtQty	[0..1]	+	Short quantity	Quantidade vendida.	
2.2.2.3.2.2.10.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.11		ShortAveragePrice	ShrtAvrgPric	[0..1]	+	Average short price	Preço Médio de Venda.	
2.2.2.3.2.2.11.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average price	Preço Médio	
2.2.2.3.2.2.12		ShortGrossTradeAmount	ShrtGrssTradAmt	[0..1]	+	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	
2.2.2.3.2.2.12.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	

bvmf.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

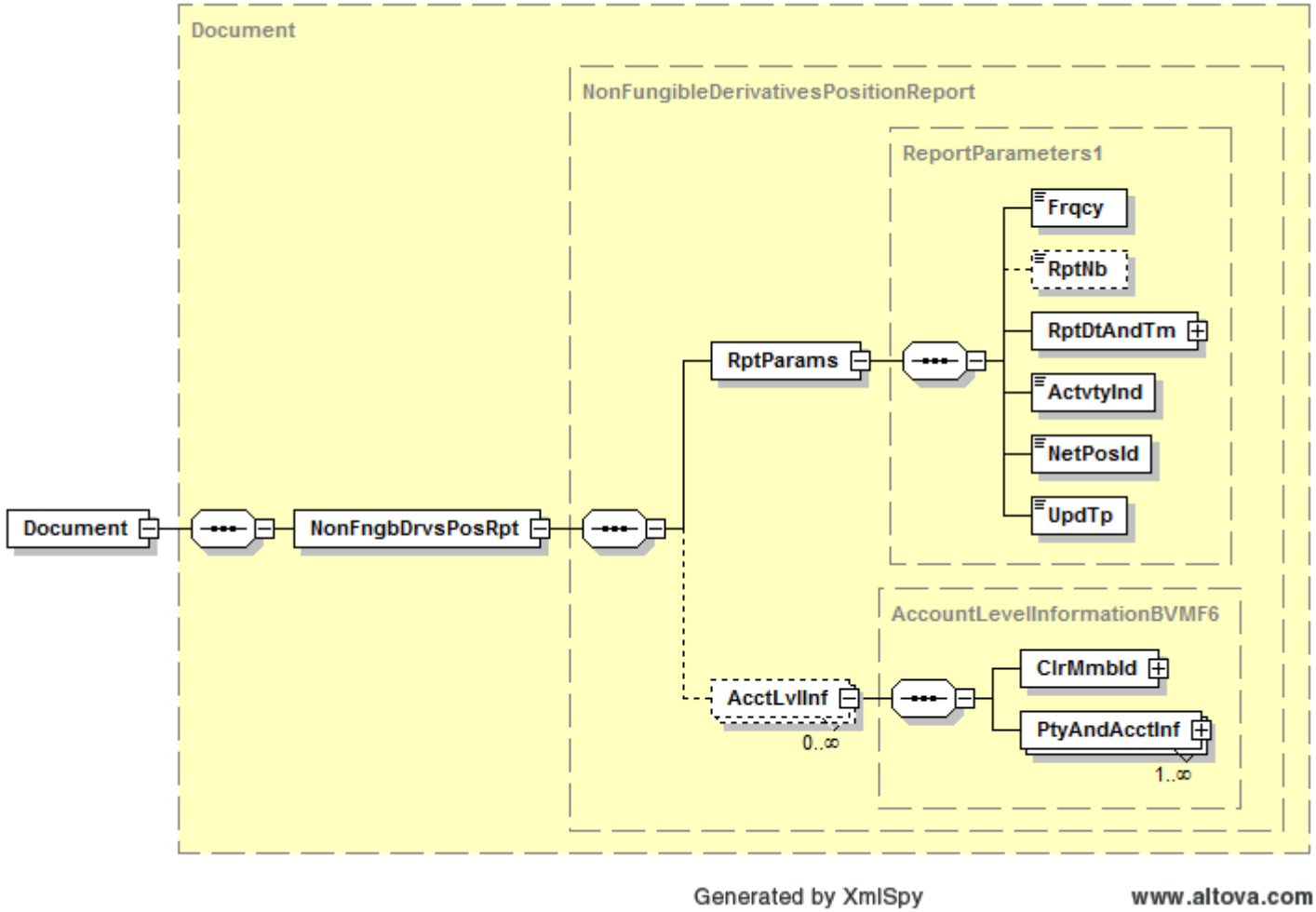
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto nos mercados de derivativos não fungíveis, basicamente, nesta primeira versão do sistema, temos o contrato a termo de ouro.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs e MCs acompanhar as posições de derivativos não fungíveis sob sua responsabilidade.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Regra 2 – O número do contrato não é disponibilizado para negócios do dia, somente a partir de D+1.

Estrutura da Mensagem bvmf.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport

Index	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos Parâmetros do Relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date and time of the report.	Data e hora do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default “true”.	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão “true”.	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX" .	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	

2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides Account Level Information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information	Informações do Membro de Compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party (TP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	

2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account identification.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.2.2.3		NonFungibleDerivativesPositionInformation	NonFngbDrvsPosInf	[1..*]	+	This block provides Non Fungible Derivatives position information.	Este bloco fornece informações das posições de derivativos não fungíveis.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in theTrade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue,	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA	

						followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.3.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

2.2.2.3.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	

2.2.2.3.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.5		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	+	Provides Settlement Date (Expired date)	Data de Vencimento	
2.2.2.3.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.6		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	Provides Trade Information	Informações de Negociação	
2.2.2.3.6.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do negócio.	
2.2.2.3.6.2		ContractNumber	CtrctNb	[0..1]	int	Contract number.	Número do contrato.	R2
2.2.2.3.7		Side	Sd	[1..1]	Side1Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
2.2.2.3.8		Quantity	Qty	[1..1]	+	Provides the number of traded contracts	Informações da quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.9		ForwardPrice	FwdPric	[1..1]	+	Price of the forward contract.	Preço do contrato a termo.	
2.2.2.3.9.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price of the forward contract.	Preço do contrato a termo.	
2.2.2.3.10		PositionValue	PosVal	[1..1]	+	Position Value	Valor da posição.	
2.2.2.3.10.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Position Value.	Valor da posição.	

bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

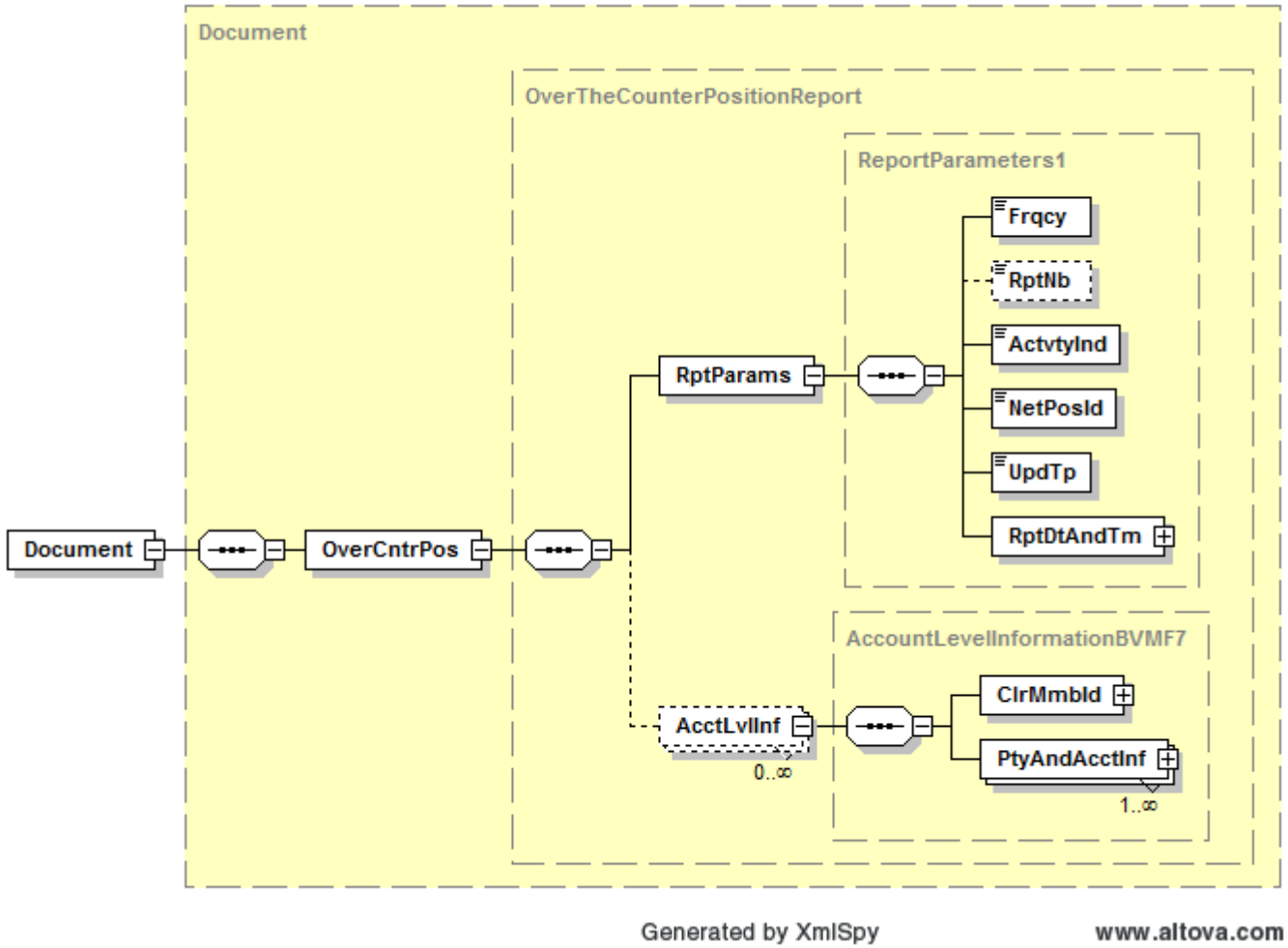
Esta mensagem traz as informações de posição em aberto nos mercados de derivativos de balcão com característica de contraparte central garantidora.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs e MCs acompanhar as posições em aberto de derivativos balcão sob sua responsabilidade. São disponibilizadas as informações básicas das posições de balcão, detalhes destas posições devem ser obtidos no sistema de registro de mercado de balcão.

No caso de contratos de balcão com garantia parcial, é disponibilizado no sistema apenas informações da parte que tem a responsabilidade de depósito de colaterais.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mensagem bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the net position.	Parâmetros relacionados com a posição líquida.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default “true”.	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão “true”.	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX" .	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date and time of the report.	Data e hora do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information.	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIde	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	

		ntification						
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuida a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndActInf	[1..*]	+	This block identifies the party (TP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party details identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.2.2.3		OverTheCounterInformation	OverTheCntrInf	[1..*]	+	This block provides the Over The Counter position information	Este bloco fornece informações sobre posição de OTC.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	

2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		ContractDetails	CtrctDtls	[1..1]	+	Displays details about a contract, such as identification, date, etc. codes.	Apresenta detalhes a respeito de um contrato, como sua identificação, data, codigos etc.	
2.2.2.3.2.1		ContractType	CtrctTp	[1..1]	ExternalContractTypeCode	Contract typeE.g: Swap This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternaContractTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de contrato. Ex: Swap Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalContractTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.3.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	Information about trade.	Informações sobre a negociação.	
2.2.2.3.2.2.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract Number.	Número do contrato.	
2.2.2.3.2.3		ContractCode	CtrctCd	[1..1]	Max5Text	Code that identifies an OTC contract type. E.g.: SCE; SCL; SCP; SDC; others	Código que identifica um contrato de OTC.Ex: SCE; SCL; SCP; SDC.	
2.2.2.3.2.4		RegistrationDate	RegnDt	[1..1]	+	Date when the contract has been registered in the OTC System	Data em que o contrato foi registrado no sistema de balcão.	
2.2.2.3.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.5		StartDate	StartDt	[1..1]	+	Date when the contract starts to be valued	Data de Inicio de Valorização.	
2.2.2.3.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	

2.2.2.3.2.6		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	+	Date when the contract expires	Data em que se expira o contrato.	
2.2.2.3.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.3		BuyInstrumentCode	BuyInstrmCd	[0..1]	+	The instrument Code that represents the buy side. For swap is mandatory and for forward and flexible options, this field will be filled in only when the trade is a buy.	Código de instrumento da ponta de compra. Para swap este campo é sempre informado, para termos e as opções flexíveis, este campo será preenchido somente quando a natureza da posição for comprada.	
2.2.2.3.3.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.4		SellInstrumentCode	SellInstrmCd	[0..1]	+	The instrument Code that represents the sell side. For swap is mandatory and for forward and flexible options, this field will be filled in only when the trade is a sell.	Código de instrumento da ponta de venda. Para swap este campo é sempre informado, para termos e as opções flexíveis, este campo será preenchido somente quando a natureza da posição for vendida.	
2.2.2.3.4.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.5		RegisteredVolume	RegdVol	[1..1]	+	Registered volume.	Volume registrado.	
2.2.2.3.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	

BVBG.016.01 – Arquivo de Movimentação de Posição de Derivativos (“DerivativesPositionMovement”)

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

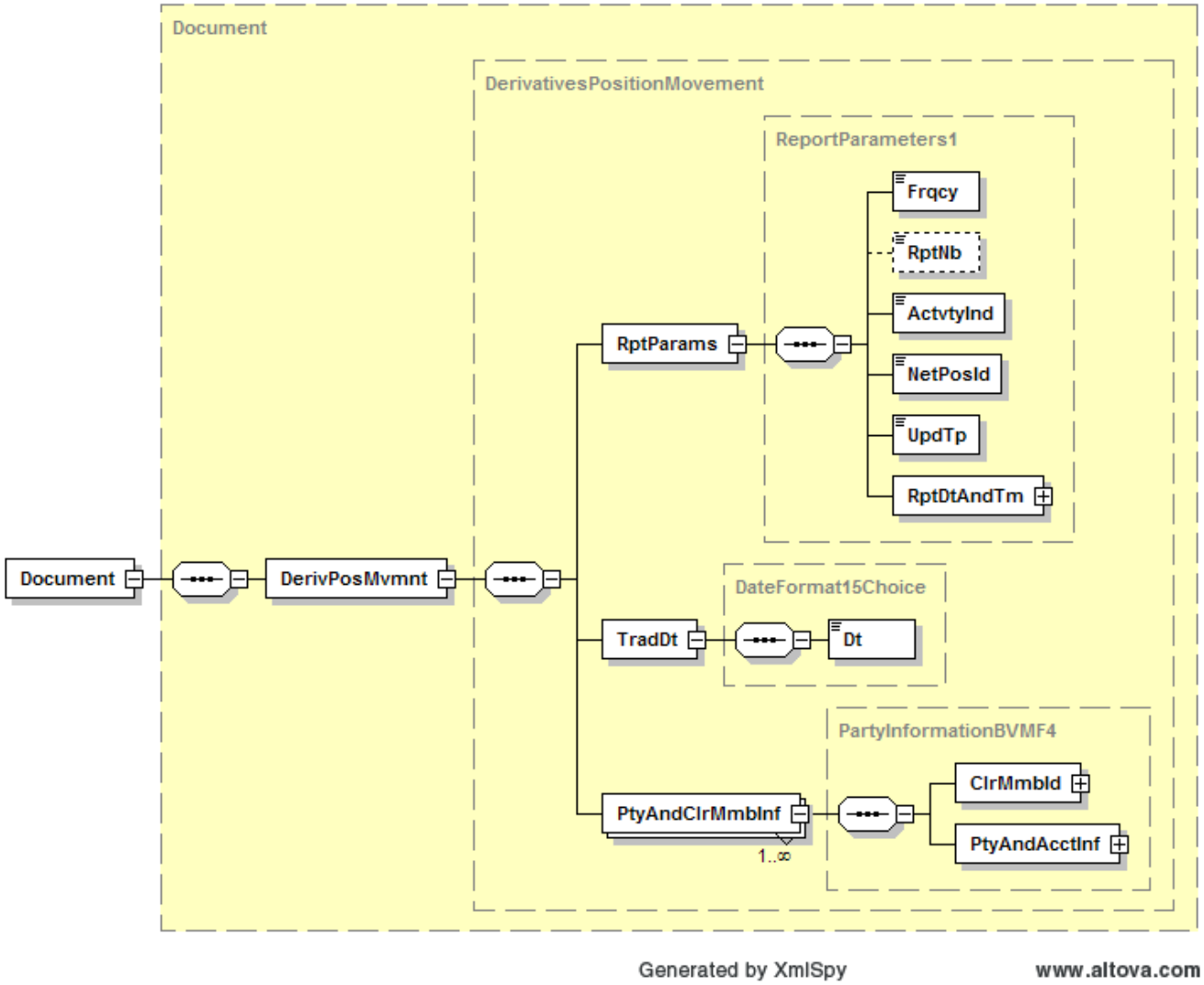
Arquivo gerado para PNPs e PLs, no final de cada data de movimento, com detalhes dos negócios efetuados nos mercados de derivativos fungíveis da BM&FBOVESPA. Esse arquivo é composto pela mensagem (bvmf.025.01).

Uso

Esse arquivo permite ao participante verificar os detalhes dos negócios realizados no mercado de derivativos fungíveis.

Diagrama da Mensagem bvmf.025.01

O arquivo “DerivativesPositionMovement” (BVBG.016.01) é composto pela mensagem bvmf.025.01.


Document
DerivativesPositionMovement
ReportParameters1
Frqcy
RptNb
ActvtyInd
NetPosId
UpdTp
RptDtAndTm
RptParams
Document
DerivPosMvmnt
DateFormat15Choice
TradDt
Dt
PartyInformationBVMF4
ClrMmbId
PtyAndClrMmbInf
PtyAndAcctInf
1..∞
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

Regra 1 – Não aplicável para opções sobre ações.

Regra 2 - Os campos abaixo somente terão informação quando da inclusão de opções sobre ação no Controle de Posição:

- Distribuição da opção;
- ISIN do ativo objeto;
- Distribuição do ativo objeto;
- Indicador tipo de série; e
- Fator de cotação.

Regra 3 – Aplicável somente para opções.

Estrutura da Mensagem bvmf.025.01 – DerivativesPositionMovement

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[0..1]	+	Parameters related to the report	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	

1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão .	
2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.0		PartyAndClearingMemberInformation	PtyAndClrMmbInf	[1..*]	+	Provides Party and Clearing Member Information	Informações do Participante e do Membro de Compensação.	
3.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information	Informações do membro de compensação.	
3.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
3.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..1]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
3.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
3.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

						The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2.2		AccountAndInstrumentInformation	AcctAndInstrmInf	[1..*]	+	Provides Account and Instrument Information.	Informações da Conta do Participante e do Instrumento.	
3.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification	Fornece dados de identificação da conta.	
3.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.2.2.2		InstrumentInformation	InstrmInf	[1..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
3.2.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
3.2.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
3.2.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
3.2.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	

3.2.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.2.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.2.2.2.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
3.2.2.2.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

3.2.2.2.2.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
3.2.2.2.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

3.2.2.2.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.2.2.2.3.2		RoundLotContract Size	RndLotCtrct Sz	[1..1]	DecimalNumber	For options on equities= Round lot For financial and comoditties derivatives = Contract multiplier Definition Round lot: Multiple and minimum quantity of securities that can be purchased or sold. Definiiton Contract size: Ratio or multiplying factor used to convert the contract quotation to the contract size	Para opções sobre equities = Lote padrão. Para derivativos de comoditties e financeiros= Multiplicador do contrato Definição de Lote padrão: Quantidade mínima e múltiplia de papéis que pode ser adquirida ou vendida. Definição de tamanho do contrato: Relação ou fator de multiplicação utilizado para converter a cotação do contrato no tamanho do contrato.	
3.2.2.2.3.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	

3.2.2.2.3.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	R1
3.2.2.2.3.5		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	R2
3.2.2.2.3.6		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o estilo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).	R3
3.2.2.2.3.6.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Tipos de Opções expressas como na ISO 20022. Os valores válidos são:CALL and PUTT	
3.2.2.2.3.7		OptionDistributionIdentification	OptnDstrbtnId	[0..1]	int	Distribution number of the option.	Número de distribuição da opção.	R2

3.2.2.2.3.8		UnderlyingInstrument	UndrlygInstrm	[0..1]	Max12Text	Underlying Security Identifier International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	Identificador do instrumento subjacente. INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	R2
3.2.2.2.3.9		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Option's underlying asset distribution code	Número da distribuição do ativo objeto da opção.	R2
3.2.2.2.3.10		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado em que o titular de um derivativo vai comprar ou vender um instrumento subjacente.	R3
3.2.2.2.3.10.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Exercise price	Preço de exercício	
3.2.2.2.3.11		OptionStyle	OptnStyle	[0..1]	+	Specifies how an option can be exercised (American, European)	Informa como a opção pode ser exercida. Ex:	R3

							Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento.	
3.2.2.2.3.11.1		Code	Cd	[1..1]	OptionStyle2Code	Option style expressed as an ISO 20022 code.	Informa como a opção pode ser exercida. Ex: Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento. Valores Válidos AMER ou EURO.	
3.2.2.2.3.12		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	+	Provides Expiration date	Data de vencimento.	
3.2.2.2.3.12.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.2.2.2.4		TradeDetails	TradDtls	[1..*]	+	Provides the trade details.	Fornece os detalhes do negócio.	
3.2.2.2.4.1		Side	Sd	[1..1]	Side1Code	Coded list to specify the side of the trade.The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
3.2.2.2.4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do negócio.	
3.2.2.2.4.3		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Provides Allocation Information.	Informação sobre a alocação.	
3.2.2.2.4.3.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	
3.2.2.2.4.4		Quotation	Qtn	[1..1]	+	Trade price	Preço do negócio.	
3.2.2.2.4.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Trade price	Preço do negócio.	
3.2.2.2.4.5		UnitPrice	UnitPric	[0..1]	+	Trade price converted to unit price, only applicable for interest rate instruments.	Preço de negócio convertido em preço unitário, aplicável apenas para instrumentos de taxa de juros.	
3.2.2.2.4.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistori	Unit price.	Preço unitário	

					cCurrencyAnd2DecimalAmount			
3.2.2.2.4.6		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Trade type code. This filed requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade.	
3.2.2.2.4.7		TradeStrategy	TradStrtgy	[0..1]	+	Strategy code. Only applicable when the position comes from a strategy trade.	Código da estratégia. Aplicável somente quando a posição é proveniente de uma estratégia.	
3.2.2.2.4.7.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, etc.	Ativo associado ao papel., tal como DOL BGI OZ1, WDL, CNI, etc.	
3.2.2.2.4.8		AllocatedQuantity	AllctdQty	[1..1]	+	Allocated quantity	Quantidade Alocada (quantidade do negócio alocado para o investidor)	
3.2.2.2.4.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.2.2.2.4.9		NettedQuantity	NetdQty	[1..1]	+	Netted quantity	Quantidade alocada que foi encerrada por compensação .	
3.2.2.2.4.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.2.2.2.4.10		NonNettedQuantity	NonNetdQty	[1..1]	+	Non netted quantity	Quantidade alocada que não foi encerrada por compensação.	
3.2.2.2.4.10.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.2.2.2.4.11		VariationMarginNetted	VartnMrgnNetd	[0..2]	+	Variation margin generated by the netted quantity	Ajuste diário da ponta compensada.	
3.2.2.2.4.11.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin	Ajuste diário	
3.2.2.2.4.11.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a	Crédito ou débito.	

						debit.		
3.2.2.2.4.12		VariationMarginNonNetted	VartnMrgnNonNetd	[0..2]	+	Variation margin generated by the non netted quantity	Ajuste diário da ponta não compensada.	
3.2.2.2.4.12.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin.	Ajuste diário.	
3.2.2.2.4.12.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
3.2.2.2.4.13		InitialValue	InitlVal	[0..1]	+	Initial value of the dollar swap contract	Valor inicial do contrato de swap cambial com ajuste.	
3.2.2.2.4.13.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Initial value.	Valor inicial.	
3.2.2.2.4.14		PremiumNetted	PrmNetd	[0..2]	+	Premium generated by the netted quantity	Prêmio da ponta compensada	
3.2.2.2.4.14.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Premium	Prêmio	
3.2.2.2.4.14.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
3.2.2.2.4.15		PremiumNonNetted	PrmNonNetd	[0..2]	+	Premium generated by the non netted quantity	Prêmio da ponta não compensada.	
3.2.2.2.4.15.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Premium.	Prêmio.	
3.2.2.2.4.15.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	

bvmf.076.01 - StrategyBreakdownRequest

Funcionalidade da Mensagem

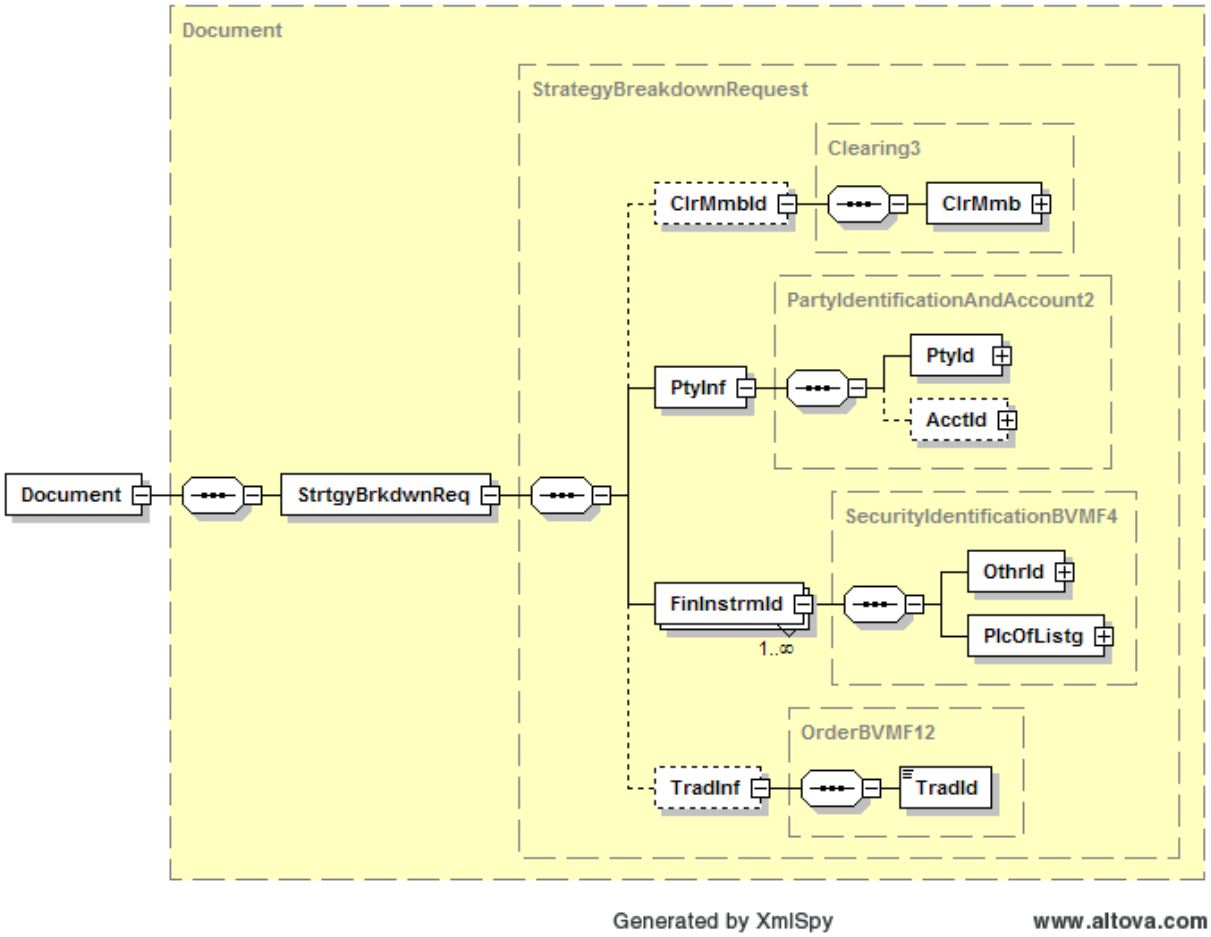
Escopo

O sistema de controle de posições é responsável por efetuar a quebra dos negócios de estratégia realizados no mercado de derivativos financeiros e de commodities. Através desta mensagem os PNPs e PLs podem solicitar de forma intradiária o arquivo com o resultado momentâneo do processo de quebra de estratégias.

Uso

Esta mensagem permite uma série de filtros para atender as necessidades específicas do participante. O instrumento é um atributo mandatório, porém pode se filtrar a conta e o número de negócio.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – A informação do instrumento de estratégia que está sendo consultado deve ser provida informando-se os três atributos que identificam o instrumento dentro da Câmara, ou seja, *Exchange ID, Security Source e Security ID.*

Estrutura da Mensagem bvmf.076.01 – StrategyBreakdownRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[0..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informações do Membro de Compensação.	
1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Party that legally owns the account.	Parte que possui legalmente a conta.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..*]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
3.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	R1
3.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
3.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	R1
3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	R1
4.0		TradeInformation	TradInf	[0..1]	+	Information about trade.	Informação sobre o negócio.	
4.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	

BVBG.027.01 – StrategyBreakdownResponse

O arquivo “StrategyBreakdownResponse” (BVBG.027.01) é composto pela mensagem (bvmf.77.01)

Funcionalidade da Mensagem

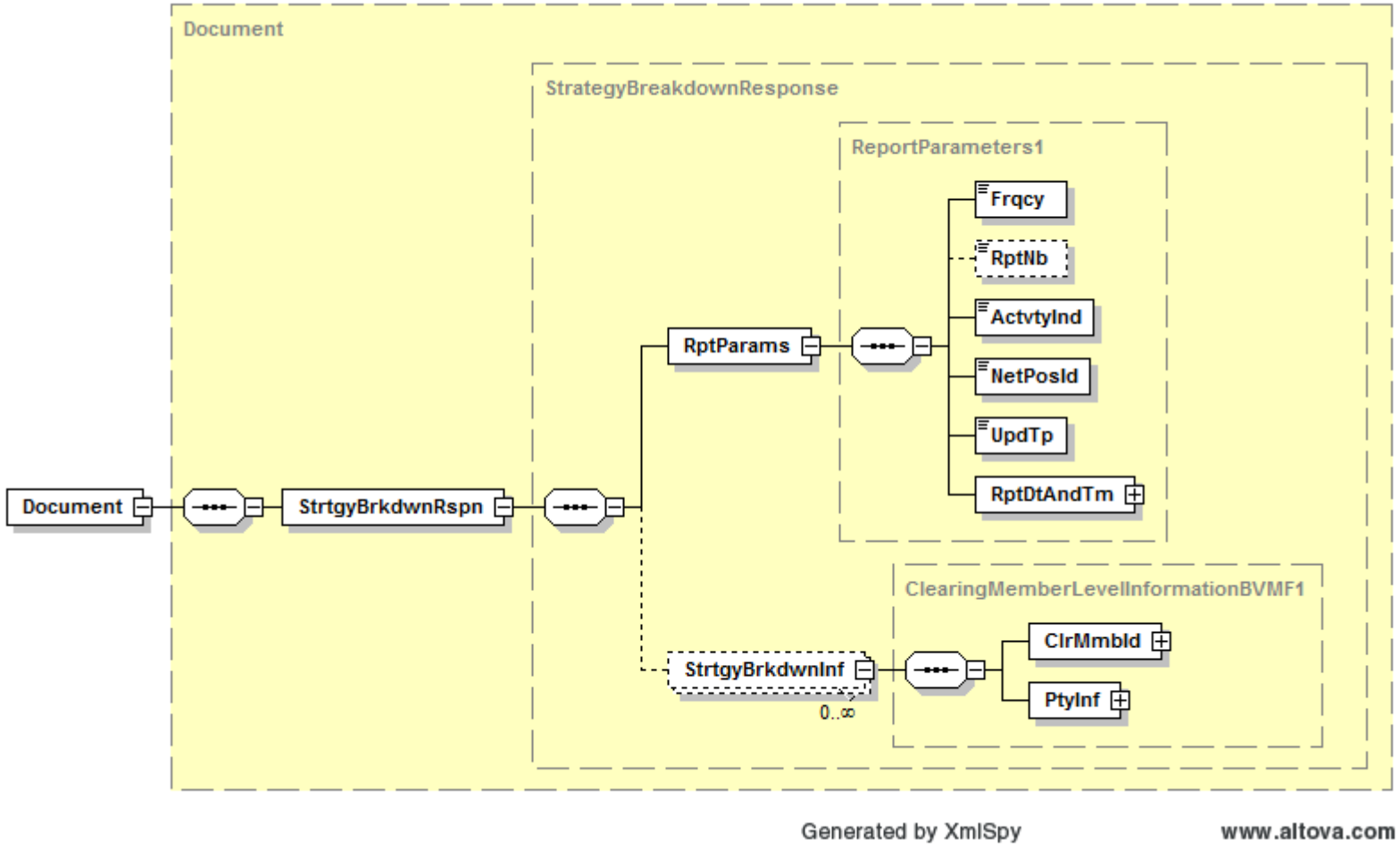
Escopo

O arquivo de quebra de estratégia é gerado sob demanda como resposta da mensagem de solicitação BVMF.076.01, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

Uso

Este arquivo permite ao participante verificar o resultado do processo de quebra de negócios de estratégia realizados nos mercados de derivativos financeiros e de commodities. O arquivo traz detalhes do instrumento de estratégia, dos negócios realizados em cada instrumento e detalhes das posições geradas em cada contrato base da estratégia.

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

Estrutura da Mensagem bvmf.077.01 – StrategyBreakdownResponse

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		StrategyBreakdownInformation	StrtgyBrkdwnInf	[0..*]	+	Block with strategy breakdown information	Bloco com informações sobre a quebra de estratégias.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	

2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	

						115 = Account Number	115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[1..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		StrategyInformation	StrtgyInf	[1..*]	+	Block with strategy instrument information.	Bloco com as informações do instrumento de estratégia.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

2.2.2.3.2.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

2.2.2.3.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[1..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4		StrategyTradeInformation	StrtgyTradInf	[1..*]	+	Strategy Trade Information	Informações sobre os negócios de estratégia.	

2.2.2.3.4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data da negociação.	
2.2.2.3.4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do negócio.	
2.2.2.3.4.3		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Allocation information	Informação sobre a alocação.	
2.2.2.3.4.3.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	
2.2.2.3.4.4		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Strategy trade price.	Preço do negócio de estratégia.	
2.2.2.3.4.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Strategy trade price.	Preço do negócio de estratégia.	
2.2.2.3.4.5		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
2.2.2.3.4.6		ConfirmationQuantity	ConfQty	[1..1]	+	Strategy trade quantity.	Quantidade do negócio de estratégia	
2.2.2.3.4.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.4.7		BreakdownInformation	BrkdwnInf	[1..*]	+	Information related to the positions generated by the strategy trade. Strategy legs.	Informação das posições geradas pelo negócio de estratégia. Pernas da estratégia.	
2.2.2.3.4.7.1		StrategyLegNumber	StrtgyLegNb	[1..1]	int	Strategy Leg Number	Número da perna da estratégia	
2.2.2.3.4.7.2		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
2.2.2.3.4.7.2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.4.7.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.4.7.2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.4.7.2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.4.7.2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está	

							listado.	
2.2.2.3.4.7.2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.4.7.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.4.7.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.4.7.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	

2.2.2.3.4.7.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[1..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4.7.4		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
2.2.2.3.4.7.5		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.4.7.5.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

2.2.2.3.4.7.5.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.4.7.6		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Strategy leg trade price.	Preço da perna da estratégia.	
2.2.2.3.4.7.6.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
2.2.2.3.4.7.7		Quantity	Qty	[1..1]	+	Strategy leg trade quantity.	Quantidade da perna da estratégia.	
2.2.2.3.4.7.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

bvmf.028.01 – PositionTransferInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde os PNPs ou PLs podem solicitar a transferência de posição de derivativos fungíveis e não fungíveis.

Por meio desta mensagem o participante também pode informar que há a transferência conjunta de colaterais e que, dessa forma, a avaliação de risco tanto na origem como no destino da transferência será realizada no portfólio conjunto de posições e colaterais.

Além disso, o participante pode solicitar a transferência interna de posição, onde há somente a transferência entres contas do mesmo participante. Neste tipo de transferência não há possibilidade de informar a transferência de colaterais.

Uso

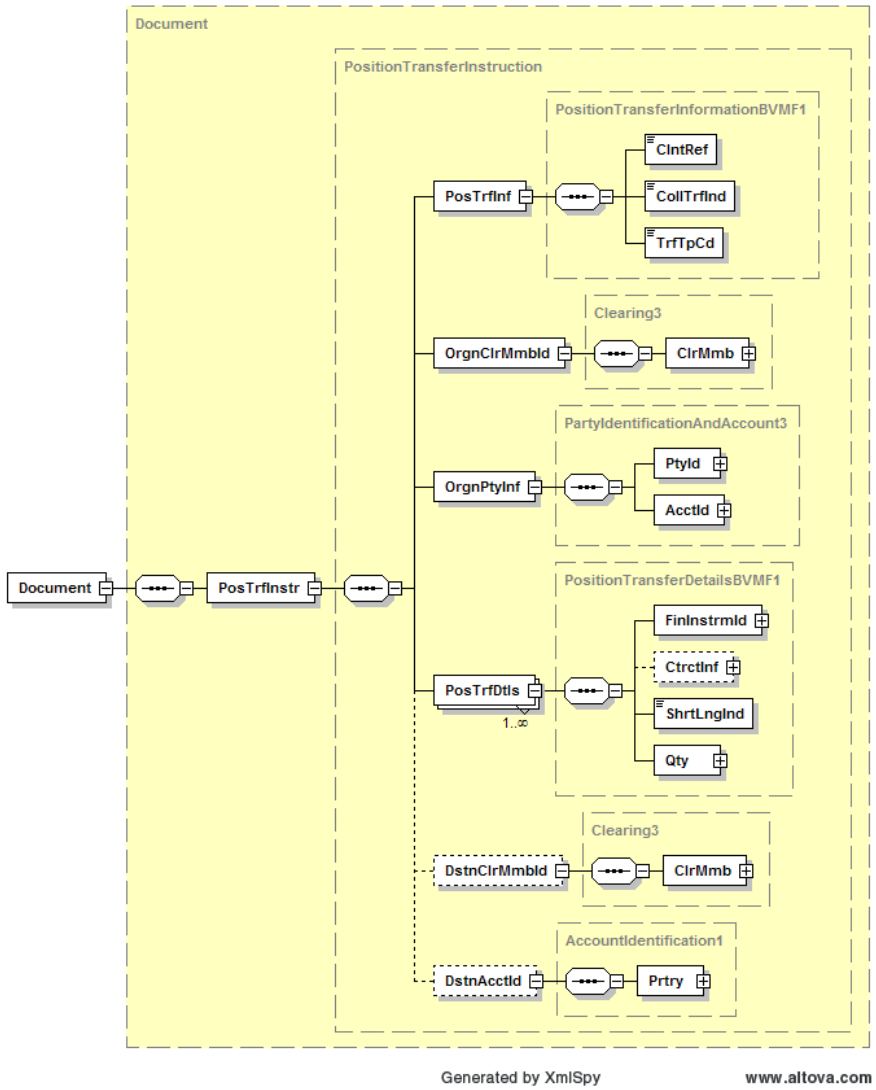
No envio da mensagem, o participante deve obrigatoriamente informar:

- os dados da origem da posição, ou seja, MC, participante e conta;
- o tipo de transferência, interna ou normal;
- se há transferência conjunta de colaterais;
- o número de identificação da transferência dado pelo próprio participante; e
- as posições a serem transferidas.

No caso de transferência do tipo interna, o participante deve informar o MC e a conta destino da transferência.

O envio da mensagem de solicitação de transferência deve obedecer os horários limite estabelecidos pela Clearing para este processo.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – A informação de transferência conjunta de colaterais, não significa que os colaterais serão transferidos automaticamente. O participante deve comandar a transferência de colaterais no sistema de garantia. Vide documento de fluxo de mensagens.

Regra 2 – O número do contrato a termo deve ser informado caso o participante queira transferir um contrato em específico. Se não for informado, o sistema irá transferir todos os contratos identificados pela trinca de instrumentos informada na mensagem.

Regra 3 - No caso de transferência do tipo interna, o participante deve informar o MC e a conta destino da transferência.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer, such as party reference (transfer number assigned by party), collateral request and internal transfer information.	Este bloco contém informações sobre a solicitação de transferência de posição, Código de referência do participante de negociação pleno (número de transferência gerado/conhecido pelo participante de negociação pleno), solicitação de transferência conjunta de colateral e as informações de transferência interna.	
1.1		ClientReference	ClntRef	[1..1]	Max35Text	The field "Client Reference" is used to identify the reference assigned by participant to position transfer.	O atributo "Client Reference" é usado para identificar a referência dada pelo participante para a transferência de posição.	
1.2		CollateralTransferIndicator	CollTrfInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether the transfer will have collateral. E.g: TRUE FALSE	Indica se na solicitação de transferência as garantias serão transferidas ou não. Ex TRUE FALSE	R1

1.3		TransferTypeCode	TrfTpCd	[1..1]	ExternalTransferTypeCode	Indicates if the position transfer is an internal transfer, e.g. The transfer is to the same Party, but different Account and/or Clearing Member. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Indica se a transferência é uma transferência de posição interna, por exemplo A transferência é para o mesmo participante de negociação pleno, mas a conta e / ou Membro de Compensação são diferentes. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.0		OriginClearingMemberIdentification	OrgnClrMmbId	[1..1]	+	Provides details about the origin clearing member identification in a position transfer process.	Fornece detalhes sobre a identificação do membro de compensação origem em um processo de transferência de posição.	
2.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		OriginPartyInformation	OrgnPtyInf	[1..1]	+	Party that legally owns the origin account in a position transfer process.	Participante que legalmente é proprietário da conta origem em um processo de transferência de posição.	
3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.0		PositionTransferDetails	PosTrfDtls	[1..*]	+	Provides the position transfer details. E.g The instruments and the quantity to be transferred.	Fornece detalhes da transferência de posição. Ex: identificação do instrumento e quantidade a ser transferida.	

4.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification will be transferred in the position transfer process.	Fornece detalhes da identificação do instrumento que será transferido no processo de transferência de posição.	
4.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
4.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
4.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
4.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
4.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
4.2		ContractInformation	CtrctInf	[0..1]	+	Information about the forward contract.	Informação sobre o contrato a termo.	R2
4.2.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do contrato.	
4.3		ShortLongIndicator	ShrtLngInd	[1..1]	ShortLong1Code	Indicates if the position is short or long.	Indica se a posição é de compra ou venda.	
4.4		Quantity	Qty	[1..1]	+	Identifies the quantity of the instruments that will be transferred in the position transfer process.	Identifica a quantidade de instrumento que será transferida no processo de transferência de posição.	
4.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

5.0		DestinationClearingMemberIdentification	DstnClrMmbId	[0..1]	+	Provides details about the destination clearing member identification in a position transfer process. This data block is only informed when is an internal transfer, e.g. The position transfer is to the same Party, but different Account and/or Clearing Member.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação destino no processo de transferência de posição. Este bloco somente é utilizado quando for uma transferência interna. Ex: A transferência de posição é para o mesmo participante de negociação pleno, mas para diferente conta e/ou membro de compensação.	R3
5.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
5.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
5.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
5.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

5.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
6.0		DestinationAccount Identification	DstnAcctId	[0..1]	+	Provides destination account identification.	Fornece a identificação da conta destino.	R3
6.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
6.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

bvmf.030.01 – PositionTransferCancellation

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

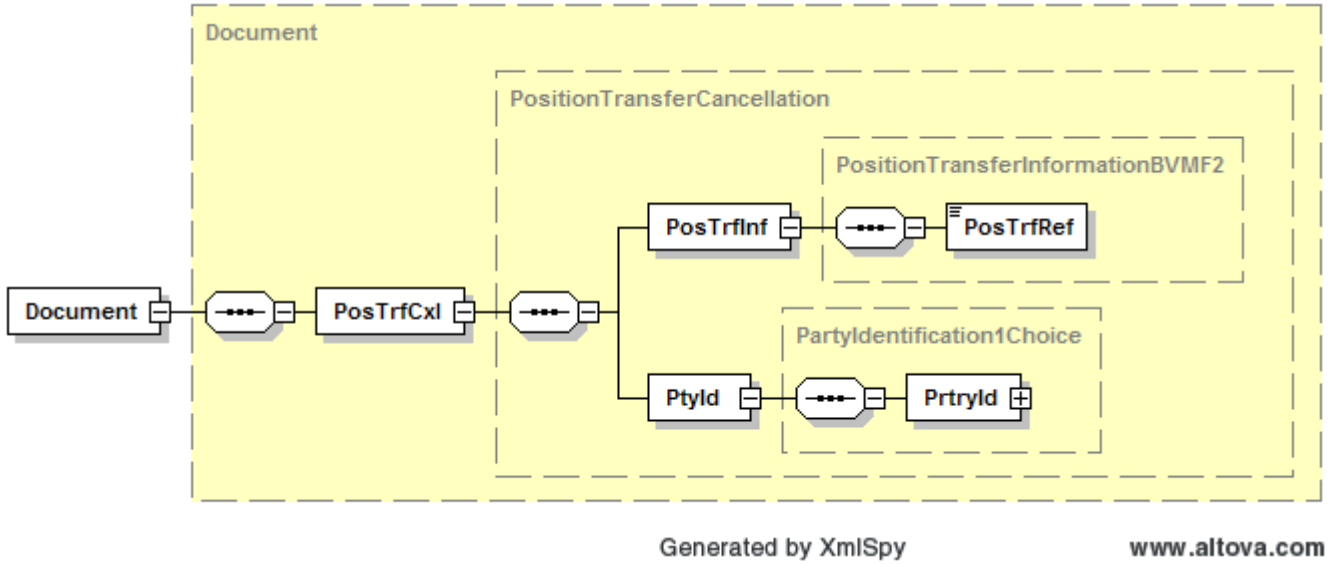
Mensagem onde os PNPs ou PLs, origem ou destino de transferência, podem solicitar o cancelamento da transferência de posição.

Uso

Esta mensagem somente pode ser utilizada até a transferência não estar efetivada. Se a transferência estiver efetivada, os participantes deverão solicitar o cancelamento diretamente para a Clearing.

O participante destino somente pode solicitar o cancelamento se já tiver ocorrido o recebimento da transferência.

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer.Transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process. The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição.Número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição. O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a a transferência de posição.	

						BM&FBOVESPA to a position transfer. By this number that the position transfer cancellation should be request.	Por este número o cancelamento da transferência de posição deverá ser solicitado.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Party that legally owns the account in a position transfer process. Party that is requesting position transfer cancellation.	Participante que legalmente é proprietário da conta em um processo de transferência de posição.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

bvmf.031.01 – PositionTransferStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência são informados do seu status.

Uso

Todos os passos do processo de transferência de posição podem ser realizados por tela ou mensagem.

Independentemente da forma como as etapas do fluxo são realizadas, todos os participantes envolvidos no fluxo receberão mensagens de atualização de status.

A mensagem de atualização de status é enviada nas seguintes situações:

- Alteração do status da transferência;

- Requisição de aprovação;

- Aprovação;

- Rejeição;

- Por requisição dos participantes;

- Cancelamento;

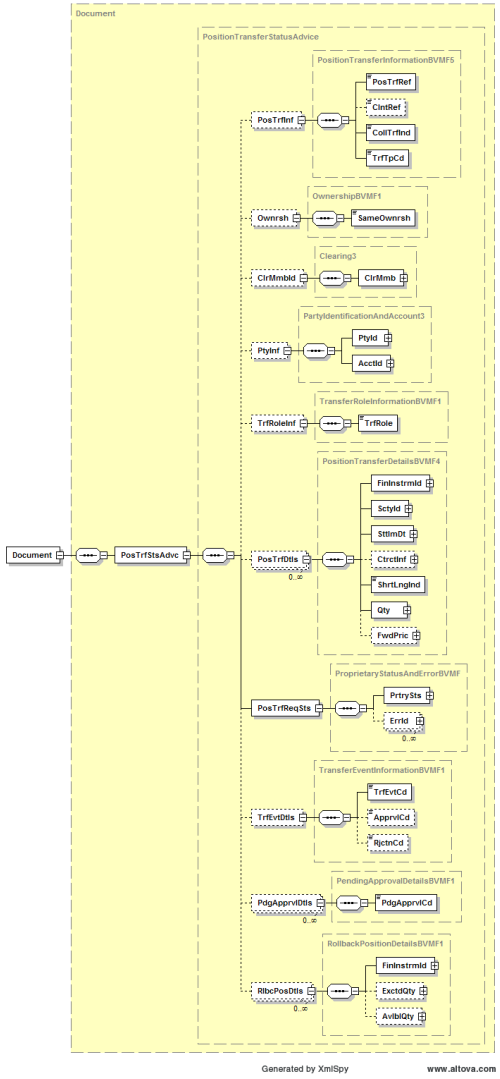
- Cancelamento de transferência em virtude de exercício ou entrega física; ou

- Erro de negócio.

O participante e MC destino somente receberão esta mensagem a partir do momento em que a transferência for recebida pelo destino.

Esta mensagem também pode ser gerada por requisição enviada pela mensagem bvmf.032.01.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O número de referência somente será informado para o participante origem da transferência.

Regra 2 – Somente será informado a partir do recebimento da transferência pelo destino.

Regra 3 – Se o participante ou MC for origem e destino, receberá mais de uma mensagem de status.

Regra 4 – Somente informado se houver contrato a termo no conteúdo da transferência.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[0..1]	+	This block contains information regarding the position transfer. Transfer number, client reference, collateral indicator and transfer type.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição. Número de transferência, referência do participante, indicador de transferência conjunta de colaterais e tipo de transferência.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
1.2		ClientReference	ClntRef	[0..1]	Max35Text	The field "Client Reference" is used to identify the reference assigned by participant to position transfer.	O atributo "Client Reference" é usado para identificar a referência dada pelo participante para a transferência de posição.	R1
1.3		CollateralTransferIndicator	CollTrfInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether the transfer will have collateral. E.g: TRUE FALSE	Indica se haverá transferência conjunta de colaterais. Ex TRUE FALSE	

1.4		TransferTypeCode	TrfTpCd	[1..1]	ExternalTransferTypeCode	Indicates if the position transfer is an internal transfer, e.g. The transfer is to the same Party (Broker) but different Account and/or Clearing Member. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Indica se a transferência é uma transferência de posição interna, por exemplo A transferência é para o mesmo participante de negociação pleno (corretora), mas conta e / ou Membro de Compensação são diferentes. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.0		Ownership	Ownrsh	[0..1]	+	Specifies whether the transfer occurs between the same account ownership	Informa se a transferência de posição ocorre entre o mesmo titular da conta.	R2
2.1		SameOwnership	SameOwnrsh	[1..1]	YesNoIndicator	Specifies whether the transfer occurs between the same account ownership. . Eg: TRUE FALSE	Informa se a transferência de posição ocorre entre o mesmo titular da conta. Ex: TRUE FALSE	
3.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[0..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do membro de compensação.	
3.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
3.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		PartyInformation	PtyInf	[0..1]	+	Party that legally owns the account in a transfer process.	Participante que legalmente é proprietário da conta em um processo de transferência de posição.	
4.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
4.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece a identificação da conta.	
4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.0		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[0..1]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém a informação do papel do participante na transferencia.	
5.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the	Usado para derterminar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código	R3

						updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
6.0		PositionTransferDetails	PosTrfDtls	[0..*]	+	Provides the transfer positions details. E.g The instruments to be transferred to another party, account or clearing member.	Fornece detalhes da transferência de posição. Ex: identificação do instrumento, quantidade a ser transferida para outro participante de negociação pleno, conta.	
6.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificacao do instrumento.	
6.1.1		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
6.1.1.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
6.1.2		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
6.1.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
6.1.2.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
6.1.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
6.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contem informações do bloco de negociação.	
6.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
6.3		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	Maturity date.	Data de vencimento do contrato.	
6.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	

6.4		ContractInformation	CtrctInf	[0..1]	+	Information about the forward contract.	Informação sobre o contrato a termo.	R4
6.4.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do contrato.	
6.5		ShortLongIndicator	ShrtLngInd	[1..1]	ShortLong1Code	Indicates if the position is short or long.	Indica se a posição é comprada ou vendida.	
6.6		Quantity	Qty	[1..1]	+	Identifies the quantity of the instrument that will be transferred in the position transfer process.	Identifica a quantidade do instrumento que será transferida no processo de transferência de posição.	
6.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
6.7		ForwardPrice	FwdPric	[0..1]	+	Price of the contract forward.	Preço do contrato a termo.	R4
6.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
7.0		PositionTransferRequestStatus	PosTrfReqSts	[1..1]	+	Indicates the position transfer request status.	Indica a situação da solicitação de transferência de posição.	
7.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the message.	Informações da situação relacionada a mensagem.	
7.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Transfer status. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPositionTransferRequestStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Status da transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPositionTransferRequestStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
7.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
7.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Coded identification of the rule that is violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	
8.0		TransferEventDetails	TrfEvtDtls	[0..1]	+	This block provides the event that triggered the message.	Este bloco fornece o evento pelo qual a mensagem foi disparada.	
8.1		TransferEventCode	TrfEvtCd	[1..1]	ExternalTransferEventCode	This field describes the event that triggered the message. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the	Este campo descreve o evento que disparou a mensagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram	

						updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferEventCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferEventCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
8.2		ApprovalCode	ApprvlCd	[0..1]	ExternalStatusTransferEventCode	This field provides information of the user responsible for the approval event described in the field "TransferEventCode". If the transfer event description ='Transfer Approval required' or 'Transfer Approval Received', this field will be defined, stored and included in the message. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalStatusTransferEventCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este atributo fornece informações do usuário de aprovação do evento descrito no campo "TransferEventCode". Se a descrição do evento for igual a "Transfer Approval required" ou "Transfer Approval Received", então este campo será incluído na mensagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusTransferEventCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
8.3		RejectionCode	RjctnCd	[0..1]	ExternalStatusTransferEventCode	This field provides information of the user responsible for the rejection event described in the field "TransferEventCode". If the transfer event description ='Transfer Approval rejected', this field will be defined, stored and included in the message. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalStatusTransferEventCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este atributo fornece informações do usuário de Rejeição do evento descrito no campo "TransferEventCode". Se a descrição do evento for igual a "Transfer Approval Rejected", então este campo será incluído na mensagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusTransferEventCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
9.0		PendingApprovalDetails	PdgApprvlDtls	[0..*]	+	This block provides information about	Este bloco fornece informações das	

						pending approvals in the position transfer process.	pendencias de aprovação no processo de transferência de posição.	
9.1		PendingApprovalCode	PdgApprvlCd	[1..1]	ExternalPendingApprovalCode	This field provides information about all pending approvals related to position transfer process. The purpose of this field is to keep the participants updated on the status of the pending approvals of the position transfer. This field is to be updated each time RTC stores the need for an approval, and each time RTC receives an approval. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalPendingApprovalCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo fornece informações de todas as aprovações pendentes relacionadas a transferências de posição. O objetivo deste campo é manter os participantes atualizados sobre o status das aprovações pendentes da transferência de posição. Este campo é para ser atualizado a cada vez que o RTC armazena a necessidade de uma aprovação, e cada vez que o RTC recebe uma aprovação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPendingApprovalCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
10.0		RollbackPositionDetails	RlbcPosDtls	[0..*]	+	This block provides information about the quantity of instruments that have been rolled back in the transfer position process and the quantity that is still available.	Este bloco fornece informações da quantidade de instrumentos que foram revertidos num processo de transferência e a quantidade que ainda está disponível.	
10.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
10.1.1		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
10.1.1.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
10.1.2		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	

10.1.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
10.1.2.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
10.1.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
10.2		ExecutedQuantity	ExctdQty	[0..1]	+	Provides information about the quantity that has been rolled back.	Quantidade de instrumentos que foram revertidos.	
10.2.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
10.3		AvailableQuantity	AvlblQty	[0..1]	+	Provides information about the quantity that has not been rolled back yet.	Quantidade de instrumentos disponíveis para serem revertidos.	
10.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

bvmf.032.01 – RequestPositionTransferStatus

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

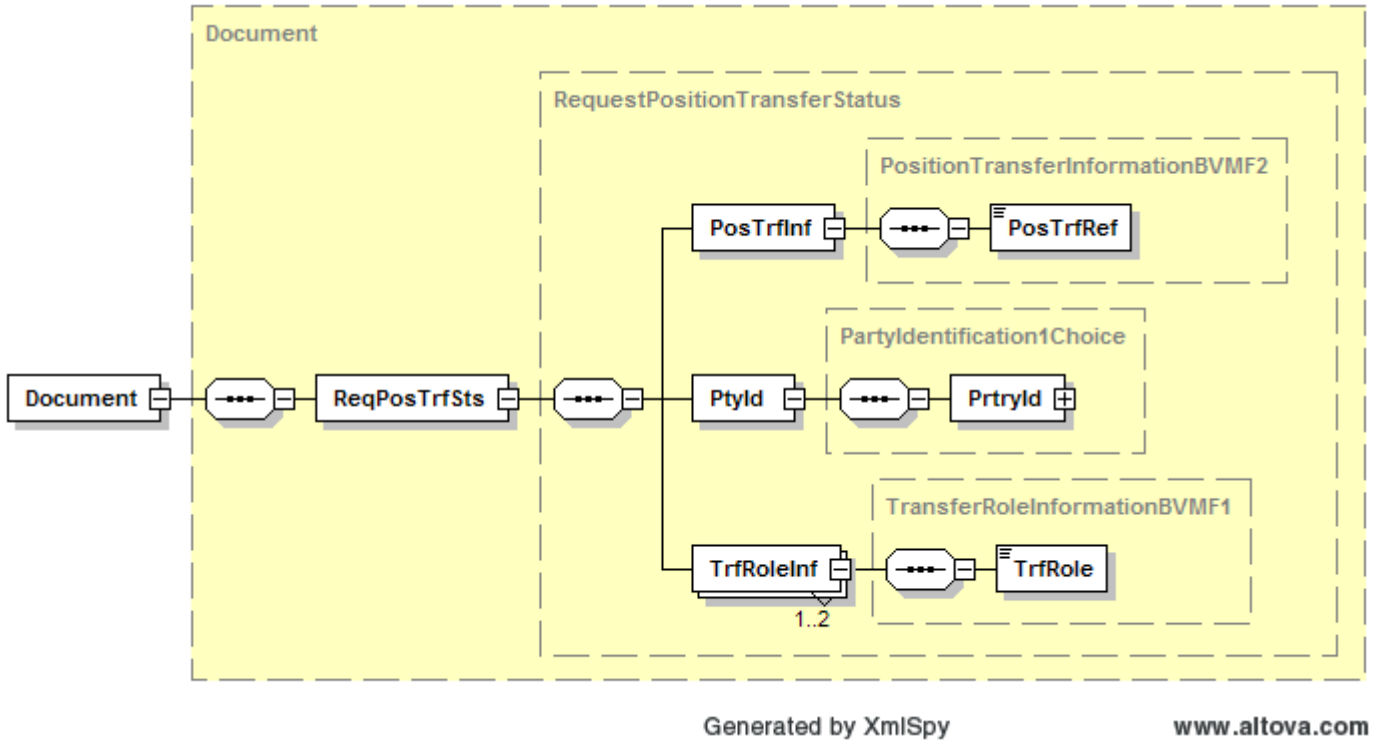
Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência podem solicitar o status da mesma.

Uso

O participante e MC destino somente podem solicitar o status a partir da efetivação do recebimento da transferência.

O envio desta mensagem deve obedecer os horários limite estabelecidos pela Clearing para este processo.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – Se o participante ou MC for origem e destino, pode solicitar a mensagem de status com até dois papéis.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra

1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) . Transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição. Número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Party of that process has a legally transfer position.	Participante que legalmente tem um processo de transferência de posição.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[1..2]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém informação sobre o papel do participante na transferência.	

3.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para determinar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	R1

bvmf.033.01 – InformationPositionTransferReceiverLeg

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde o PNP ou PL destino recebe a transferência no sistema.

Uso

No envio da mensagem, o participante deve obrigatoriamente informar:

- os dados do destino da posição, ou seja, MC, participante e conta;
- o tipo de requisição, prévia ou recebimento; e
- o código de transferência gerado pela Bolsa na solicitação.

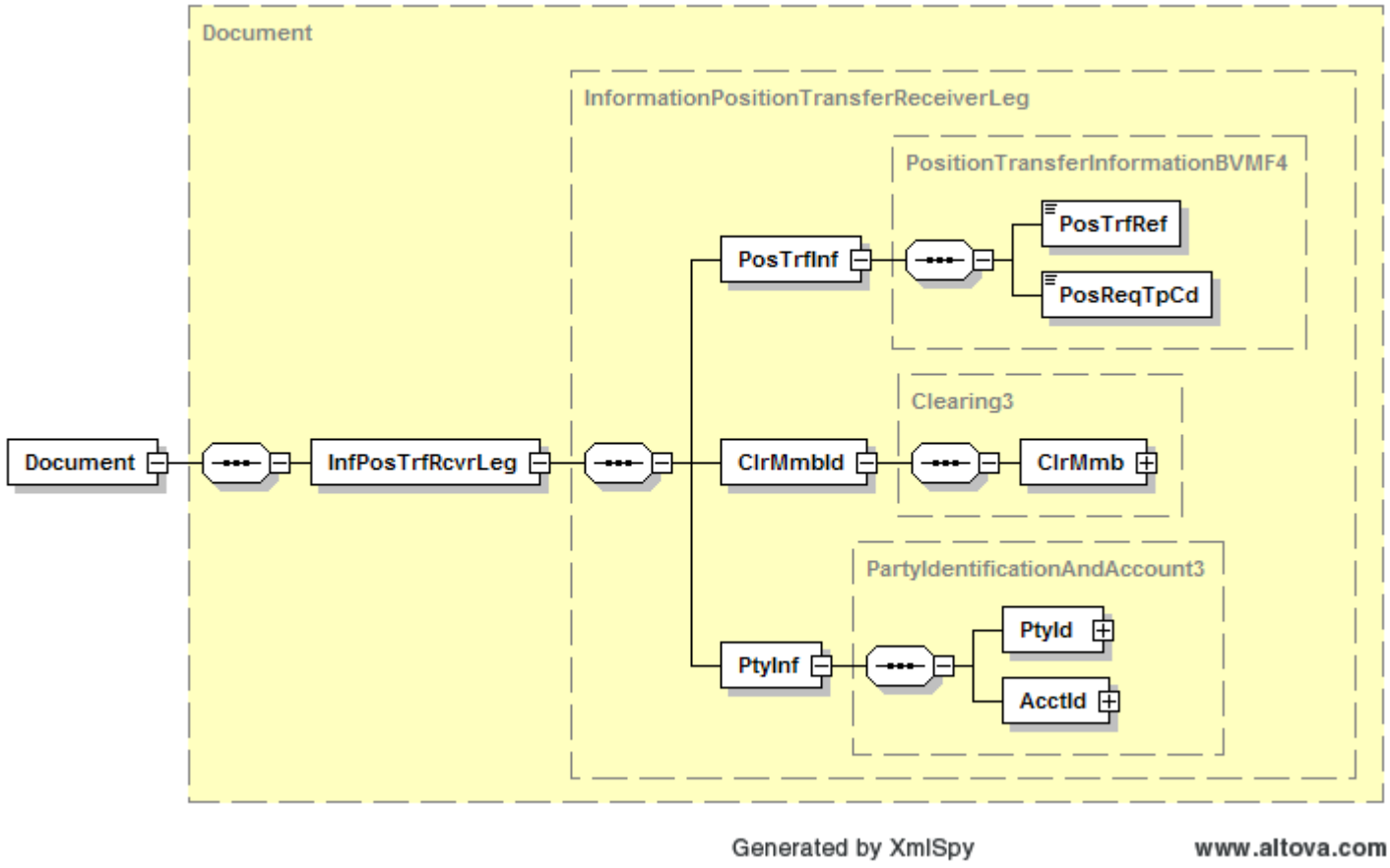
No caso de transferência do tipo interna, o recebimento é efetuado na própria solicitação.

O envio desta mensagem deve obedecer os horários limite estabelecidos pela Clearing para este processo.

O PNP ou PL pode solicitar uma prévia do recebimento para verificar a composição de posições da transferência.

A partir da efetivação do recebimento, nem um outro participante pode receber mais esta transferência.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 - O PNP ou PL pode solicitar uma prévia do recebimento para verificar a composição de posições da transferência.Estrutura da Mensagem

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer.The transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição. O número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
1.2		PositionRequestTypeCode	PosReqTpCd	[1..1]	ExternalPositionRequestTypeCode	Request types : 1 - Preview 2 – Claim	Tipos de solicitação: 1 - Prévia 2 - Recebimento	R1
2.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides details about the destination clearing member identification. This is the clearing member of party what will receive the position transfer.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação destino. Este é o membro de compensação do participante de negociação pleno que receberá a transferência de posição.	
2.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Party that legally owns the destination account in a position transfer process. This party is what receive the position transfer.	Participante que legalmente é proprietário da conta destino no processo de transferência de posição. Este participante é aquele que irá receber a transferência de posição.	
3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

bvmf.082.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

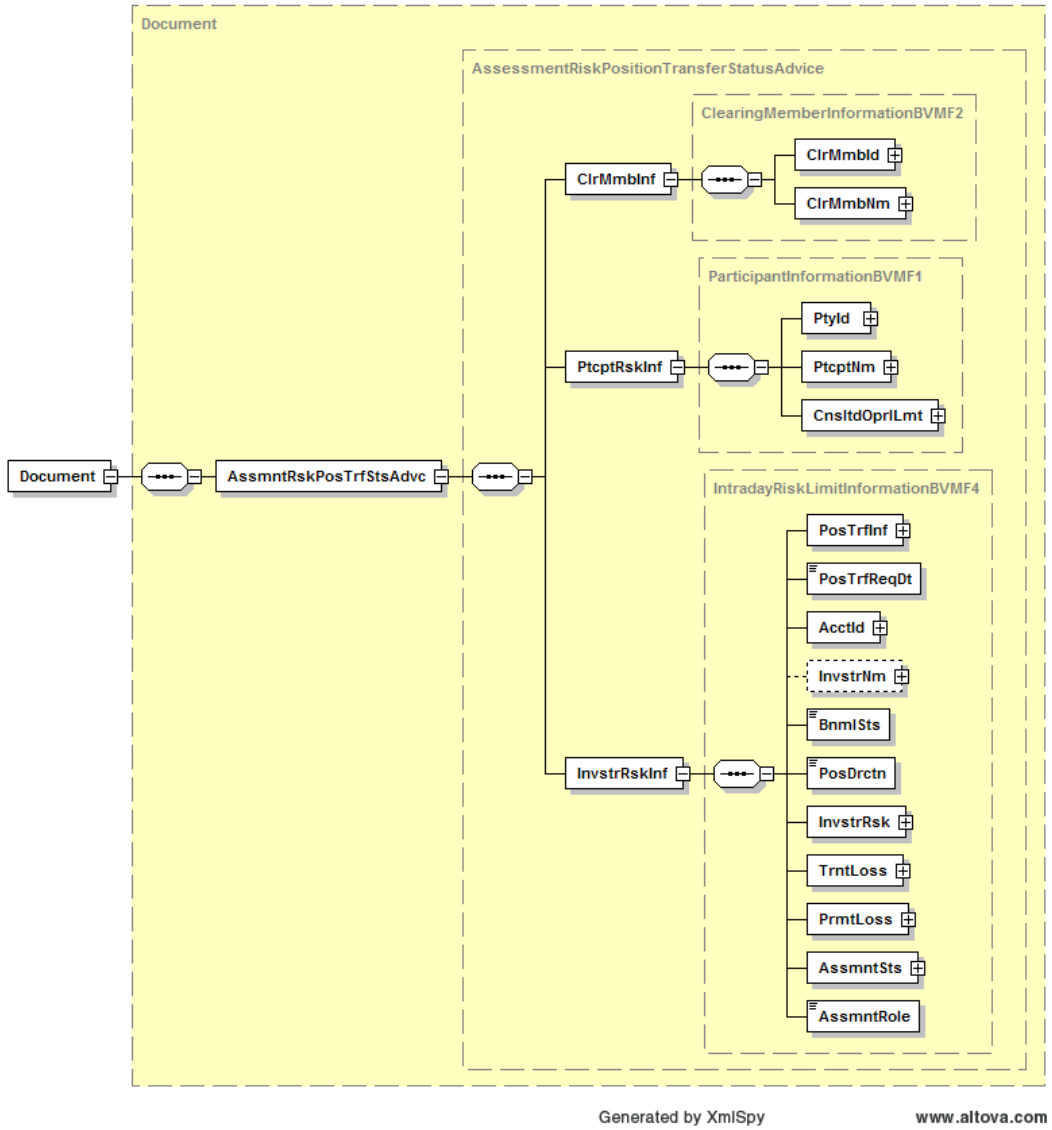
Escopo

A mensagem IntradayRiskLimitRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação informando a avaliação de risco de transferência de posição.

Uso

A mensagem IntradayRiskLimitRequest pode ser enviada voluntariamente após a avaliação do risco da transferência de posição solicitado. Se não houver violação de risco na origem, a aprovação do Membro de Compensação é desnecessária, portanto a mensagem não é enviada. Já o Membro de Compensação destino sempre precisa aprovar o fluxo de transferência.

Diagrama da Mensagem


Document
AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice
ClearingMemberInformationBVMF2
ClrMmbInf
ClrMmbId
ClrMmbNm
ParticipantInformationBVMF1
PtcptRskInf
PtyId
PtcptNm
CnsltdOprlLmt
Document
AssmntRskPosTrfStsAdvc
IntradayRiskLimitInformationBVMF4
PosTrfInf
PosTrfReqDt
AcctId
InvstrNm
BnmlSts
InvstrRskInf
PosDrctn
InvstrRsk
TrntLoss
PrmtLoss
AssmntSts
AssmntRole
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1- O atributo será vazio quando a mensagem é enviada ao Membro de Compensação e este não for participante também.

Estrutura da mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ClearingMemberInformation	ClrMmbInf	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informação do Membro de Compensação.	
1.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informa os detalhes de identificação do Membro de Compensação.	
1.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
1.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM& FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante	

							ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM& FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		ClearingMemberName	ClrMmbNm	[1..1]	+	Provides Clearing Member name.	Informação do nome do Membro de Compensação.	
1.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.0		ParticipantRiskInformation	PtcptRskInf	[1..1]	+	This block contains identification information of the Participant and the consolidated operational limit value.	Este bloco contém informação de identificação do Participante e valor do limite operacional consolidado.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	This block contains the information of participant identification	Este bloco contém as informaçãoes de identificação do participante	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM& FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BVM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		ParticipantName	PtcptNm	[1..1]	+	This block provides the information about the participant name.	Este bloco possui o nome do participante	
2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.3		ConsolidatedOperationalLimit	CnsltdOprlLmt	[1..1]	+	This block contains the Consolidated Operational Limit of the Trading Participant/ Direct participant.	Este bloco contém o Limite de Risco Operacional consolidado do Participante de Negociação Pleno/ Participante de Liquidação.	
2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
3.0		InvestorRiskInformation	InvstrRskInf	[1..1]	+	This block contains the information of the risk assessment related to transfer position.	Este bloco contém as informações da avaliação de risco relacionada a transferência de posição.	

3.1		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) such as transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição, assim como o número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
3.1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
3.2		PositionTransferRequestDate	PosTrfReqDt	[1..1]	ISODateTime	Date and time of the position transfer request.	Data da solicitação da transferência de posicao.	
3.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides Identification Account.	Fornece a identificação da conta.	
3.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.4		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides investor name.	Nome do investidor.	R1
3.4.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
3.5		BinomialStatus	BnmlSts	[1..1]	ExternalBinomialStatusCode	If instrument for Derivatives and binomial indicator is true, it means that the broker will assume the responsibilities of guarantees that were investor's responsability. If instrument for Equity and binomial indicator is true, it means that the investor will assume the responsibilities of guarantees that were the broker's responsability.	Se instrumento for Derivativo e o indicador de binômial for verdadeiro, significa que a corretora irá assumir as responsabilidades de garantias que eram do investidor. Se instrumento for Equity e o indicador de binômial for verdadeiro, significa que o investidor irá assumir as responsabilidades de garantias que eram da corretora.	
3.6		PositionDirection	PosDrctn	[1..1]	ExternalPositionDirectionCode	Indicates if this account is the account of the transfer source or destination.	Indica se a conta refere-se a origem ou destino da transferência.	
3.7		InvestorRisk	InvstrRsk	[1..1]	+	The final simulated risk result from CORE 0.	Resultado final do risco do investidor.	
3.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	

3.8		TransientLoss	TrntLoss	[1..1]	+	The amount of the transient loss if the transfer is complete. This field is available when the content of the field "Account Type" is "Normal".	Informa o valor da perda transitória da transferência completa. Este campo está disponível quando o conteúdo do "Tipo de conta" for igual a "Normal".	
3.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
3.9		PermanentLoss	PrmtLoss	[1..1]	+	The amount of the permanent loss if the transfer is complete. This field is available when the content of the field "Account Type" is "Normal".	Informa o valor da perda permanente, se a transferência for concluída. Este campo está disponível quando o conteúdo do "Tipo de conta" for igual a "Normal".	
3.9.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
3.10		AssessmentStatus	AssmntSts	[1..1]	+	Provides details about risk assesment status. Status is related do approval role and side.	Detalhes sobre o status da avaliação de risco. O status está relacionado à regra de aprovação e ao lado aprovador.	
3.10.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the message.	Informações da situação relacionada a mensagem.	
3.10.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalAssessmentStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalAssessmentStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.11		AssessmentRole	AssmntRole	[1..1]	ExternalAssessmentRoleCode	Role of last or next executor.	Função do executor (próximo ou último).	

bvmf.083.01– AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse

Funcionalidade da Mensagem

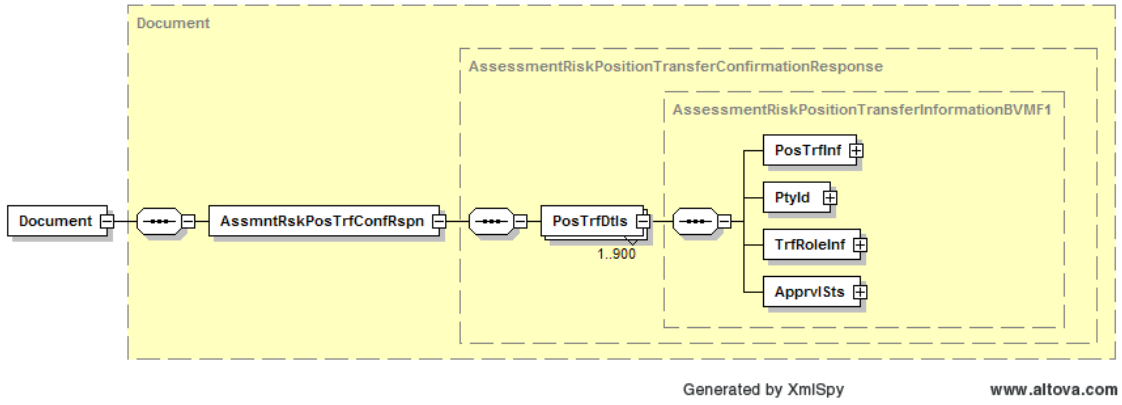
Escopo

A mensagem AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse é enviada pelo Membro de Compensação à BM&FBOVESPA para informar a aceitação ou rejeição da avaliação de risco de transferência de posição.

Uso

O Membro de compensação deve aprovar o risco de transferência de posição. Se não houver violação de risco na origem, a aprovação do Membro de Compensação é desnecessária. Já o Membro de Compensação sempre precisa aprovar o fluxo de transferência.

Diagrama da Mensagem



Estrutura da mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra

1.0		PositionTransferDetails	PosTrfDtls	[1..900]	+	This bloco contains information about risk assessment related to position transfer that will be approval or rejects by clearing member.	Este bloco contém informações sobre as avaliações de risco relacionadas a transferência de Posição que serão aprovadas ou rejeitas pelo membro de compensação.	
1.1		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) such as transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição, assim como o número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
1.2		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

1.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.3		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[1..1]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém informação sobre o papel do participante na transferência.	
1.3.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para determinar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
1.4		ApprovalStatus	ApprvlSts	[1..1]	+	Status of approval of the position transfer process. This is the response of the clearing member to approve or rejecting a request.	Situação da aprovação da avaliação de risco. Esta é a resposta do membro de compensação para aprovar ou rejeitar uma avaliação de risco.	
1.4.1		RiskApprovalType	RskApprvlTp	[1..1]	ExternalRiskApprovalTypeCode	This attribute indicates the origin of the transfer approval. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalRiskApprovalTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo indica o origem da aprovação da transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRiskApprovalTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
1.4.2		RiskAssessmentApprovalStatus	RskAssmntApprvlSts	[1..1]	ExternalApprovalStatusCode	This attribute informs whether the Clearing Member is approving or rejecting the risk assessment. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalApprovalStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo informa se o membro de compensação está aprovando ou rejeitando avaliação do risco. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalApprovalStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

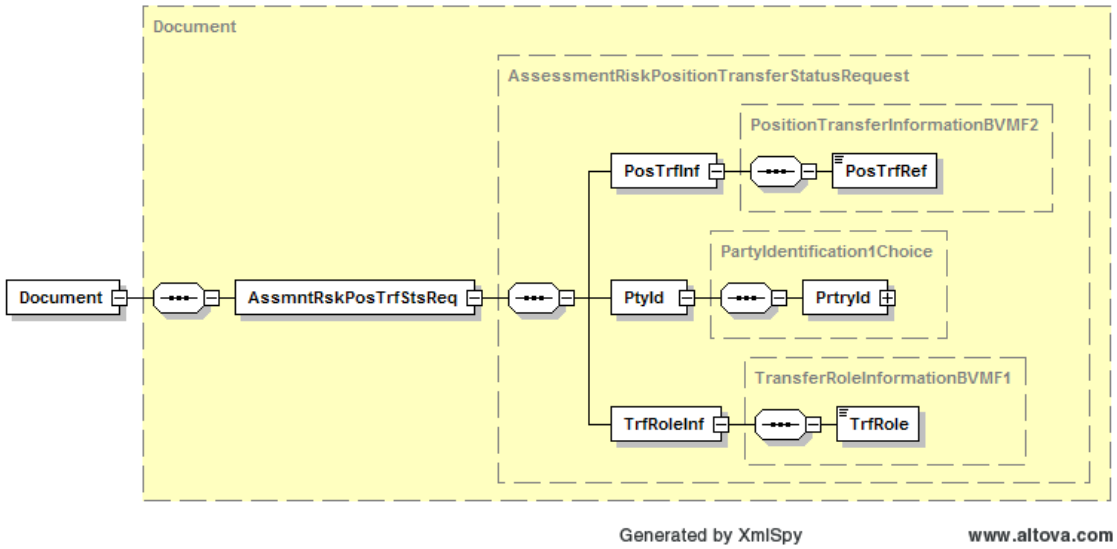
bvmf.084.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação à BM&FBOVESPA como requisição das informações atualizadas da avaliação do risco de transferência de posição.

Diagrama da Mensagem



Estrutura da mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) such as transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição, assim como o número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

3.0		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[1..1]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém informação sobre o papel do participante na transferência.	
3.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para determinar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	